

Paris, le 13 septembre 2011

La fondation Natixis soutient Andreea Minca pour sa thèse « Modélisation mathématique du risque de la contagion de défaut »

Dans le cadre de son programme de soutien à la recherche dans le domaine de la finance quantitative, la Fondation Natixis a apporté son appui à Andreea Minca pour sa thèse de doctorat en mathématiques appliquées. Soutenue le 5 septembre dernier à l'Université Pierre et Marie Curie (Paris 6), cette thèse est le résultat d'un travail original et innovant sur un thème d'actualité.

Modélisation mathématique du risque systémique et de la contagion de défaut

Ces dernières années, les différentes crises financières ont mis en lumière l'importance du risque systémique, les interactions entre les institutions financières et la nécessité de disposer d'outils pour modéliser et prévenir ce risque.

La thèse d'Andrea Minca propose également des recommandations pratiques pour les régulateurs des marchés avec une approche pour calibrer les stress tests afin d'identifier les institutions financières dont la défaillance pourrait déclencher des défauts en cascade..

Andreea Minca vient d'être recrutée comme professeur assistant à l'Université de Cornell (New York).

A propos de la fondation Natixis

La fondation Natixis a pour vocation de financer des recherches et des manifestations dans le domaine de la finance quantitative tout en apportant une aide au travail de recherche des jeunes talents. La fondation attribue des bourses de thèses de doctorat, récompense chaque année le meilleur mémoire de master spécialisé en finance quantitative et décerne tous les deux ans le prix Louis Bachelier à un jeune chercheur pour l'ensemble de ses contributions en modélisation financière. Elle est partenaire de l'Institut Europlace de Finance et membre du pôle de compétitivité « Industrie financière – Technologies et innovation ».

Contact Presse :

Victoria Eideliman
+ 33 1 +58 19 47 05