

Paris, le 5 juillet 2011

Prix 2011 du meilleur mémoire de Master de la Fondation d'entreprise Natixis

En présence de Laurent Mignon, Directeur Général de Natixis, de Michel Crouhy Président de la Fondation Natixis, Anthony Darné et Mauricio Labadie recevront respectivement le prix 2011 du meilleur mémoire de Master décerné par la Fondation d'entreprise Natixis pour la Recherche Quantitative.

Le Prix du Meilleur mémoire de Master

Ce prix récompense chaque année des travaux d'une qualité exceptionnelle sur des sujets complexes d'actualité pour les banques, les assureurs et les sociétés de gestion. Ces travaux nécessitent le recours aux techniques de la finance quantitative les plus évoluées.

Les Lauréats

Le premier mémoire primé traite du « Liability Driven Investment » dont le but est l'optimisation de l'allocation d'actifs en prenant en compte les engagements de passif. Le second mémoire propose une stratégie originale de trading algorithmique visant à optimiser les coûts d'exécution pour des ordres composés de nombreux actifs.

Anthony Darné pour son mémoire « Remporter les appels d'offres de retraite supplémentaire grâce au Liability Driven Investment ». Ce mémoire a été présenté pour le diplôme d'actuaire de l'Université Claude Bernard Lyon 1 – ISFA sous la direction du Professeur Jean-Claude Augros et réalisé dans le cadre d'un stage chez BNP Paribas Assurances.

Mauricio Labadie pour son mémoire « Optimal algorithmic trading and market microstructure », réalisé sous la direction du Professeur Edith Ginglinger de l'Université Paris Dauphine – Master 104, dans le cadre d'un stage chez Chevreux – Crédit Agricole.

La Fondation d'entreprise Natixis pour la Recherche Quantitative a pour objet le financement des recherches et manifestations dans le domaine de la Finance Quantitative (finance des marchés, gestion des risques, économétrie, finance statistique, valorisation des produits dérivés complexes). Elle finance des bourses de thèses de doctorat et des travaux de recherche universitaire sur des thèmes en prise directe avec les préoccupations actuelles des institutions financières. Elle co-organise des conférences avec des institutions universitaires de premier plan et récompense des travaux de recherche réalisés dans le cadre de thèses et de mémoires de fin d'étude.

Contacts :

Barbara Durand
Relations Presse Natixis
+33 1 58 19 47 41

Laura Lionnet
Natixis – Relations presse BFI
+ 33 1 58 55 62 76