

Paris, le 25 septembre 2012

## Prix 2012 du meilleur mémoire de master de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative

**Laurent Mignon, directeur général de Natixis, et Michel Crouhy, président de la fondation Natixis, ont remis le prix 2012 du meilleur mémoire de master décerné par la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative à Tung-Lam Dao, Marouan Iben Taarit et Adrien Grangé Cabane.**

### 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.

*« Cette année le comité scientifique de la fondation a été impressionné par la qualité des mémoires soumis pour ce prix qui, pour la grande majorité d'entre eux, complètent une analyse théorique d'un excellent niveau avec des applications numériques et un effort d'interprétation et de réflexion à la fois de nature économique et sur les méthodes numériques employées »,* souligne Michel Crouhy.

### Les lauréats

Le comité scientifique de la fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative a sélectionné cette année 3 lauréats, parmi les 11 mémoires qui ont été soumis par les directeurs de programmes, pour le Prix du meilleur mémoire de master :

**Tung-Lam Dao** de Paris 7 pour son mémoire « Momentum Strategies : From Novel Estimation Techniques to Financial Applications », réalisé dans le cadre d'un stage chez LYXOR ;

**Marouan Iben Taarit** de l'École des Ponts Paris Tech – Université Paris-Est Marne-la-Vallée pour son mémoire « Market Liquidity and Adverse Permanent Effects in Hedging Equity & Interest Rates Derivatives », réalisé au GRO du Crédit Agricole ;

**Adrien Grangé Cabane** de Paris 6 pour son mémoire « Étude des Modèles de Corrélation en Finance », réalisé dans le cadre d'un stage à la Société Générale.

*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 thèse de doctorat et des travaux de recherche universitaire sur des thèmes en prises directes 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'études.*

**Contacts presse :**

Andrea Pucnik  
+33 1 58 32 01 03

Joanne Morrow  
+ 33 1 58 55 05 12