

Paris, le 25 septembre 2015

Prix 2015 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 d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative, ont remis le prix 2015 du meilleur mémoire de master à Claire Monin, Julien Doumergue et Shuren Tan.

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. « Comme chaque année, le comité scientifique de la Fondation a été impressionné par la qualité des mémoires soumis pour ce prix sur des thèmes très variés. Nous constatons un net déplacement de la recherche en finance quantitative vers des problématiques qui touchent à la réglementation, à la gestion des risques et à la gestion d'actifs », note Michel Crouhy.

Les lauréats :

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

Claire Monin, de l'Institut de Science Financière et d'Assurances (ISFA) de l'Université de Lyon 1 : Optimisation multiobjectif de l'allocation stratégique par un algorithme génétique, réalisé chez BNP Paribas Cardif ;

Julien Doumergue, du Master M2 Probabilités & Finance de l'Université Pierre & Marie Curie – Paris VI: Optimal Hedging Strategies using Stochastic Space Barriers and its Application to Financial Products, réalisé chez BNP Paribas UK ;

Shuren Tan, of the MSc in Mathematics and Finance of Imperial College: Reconstructing the Joint Probability Distribution from Basket Prices.

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 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'études.

Contact presse : Sonia Dilouya – sonia.dilouya@natixis.com -- Tel +33 1 58 32 01 03



Follow us on Twitter! @Natixis_com