

Paris, le 23 septembre 2016

Prix 2016 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 2016 du meilleur mémoire de master à Sébastien Geeraert, Abdou Kélani, et Guillaume Ausset.

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 variés touchant à la gestion d'actifs, l'assurance, la gestion des risques, le market-making, la finance de marché et les méthodes numériques appliquées aux nouvelles problématiques réglementaires », note Michel Crouhy.

Les lauréats 2016 :

Le Comité Scientifique de la Fondation Natixis pour la Recherche Quantitative a sélectionné cette année trois lauréats parmi les 18 mémoires qui ont été soumis, provenant de 11 Masters différents situés en France, Suisse, au Royaume-Uni et en Belgique :

Guillaume Ausset, du Master Mathématiques de l'Assurance, de l'Economie et de la Finance (MASEF) : Ensembles d'Arbres – Théorie et application au scoring, réalisé au Crédit Agricole.

Sébastien Geeraert, du Master M2 Probabilités et Finance, Ecole Polytechnique et Université Pierre & Marie Curie – Paris VI : Calcul de sensibilités par AAD (Adjoint Algorithmic Differentiation), réalisé chez MUREX

Abdou Kélani, de l'ISFA – Université Lyon 1 : Couverture Optimale des Garanties de type Variable Annuities en présence de Risques Financiers Extrêmes, réalisé au Laboratoire SAF de l'ISFA

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.

A propos de Natixis

Natixis est la banque internationale de financement, de gestion, d'assurance et de services financiers du Groupe BPCE, deuxième acteur bancaire en France avec 35 millions de clients à travers ses deux réseaux, Banque Populaire et Caisse d'Épargne.

Avec plus de 16 000 collaborateurs, Natixis intervient dans trois domaines d'activités au sein desquels elle dispose d'expertises métiers fortes : la Banque de Grande Clientèle, l'Épargne & l'Assurance et les Services Financiers Spécialisés.

Elle accompagne de manière durable, dans le monde entier, sa propre clientèle d'entreprises, d'institutions financières et d'investisseurs institutionnels et la clientèle de particuliers, professionnels et PME des deux réseaux du Groupe BPCE.

Mise à jour des chiffres : 30 juin 2016

Mise à jour des chiffres : 02 août 2016

Contacts presse :

Sonia Dilouya

Tél.: +33 1 58 32 01 03

Mail: sonia.dilouya@natixis.com

Laure Sadreux

Tél.: +33 1 58 19 34 17

Mail: laure.sadreux@natixis.com

www.natixis.com

