

Paris, le 19 octobre 2016

La Fondation Natixis pour la Recherche Quantitative décerne son prix Louis Bachelier 2016 à Damir Filipović

Le Prix Louis Bachelier de la Fondation Natixis pour la Recherche Quantitative a été décerné cette année à Damir Filipović. Ce grand prix biennal est parrainé et décerné par la London Mathematical Society (LMS), en association avec la Société de Mathématiques Appliquées et Industrielles (SMAI). La célébration officielle a lieu aujourd'hui au bureau de Londres de Natixis.

Le prix Louis Bachelier de la Fondation Natixis récompense un chercheur de moins de 45 ans pour l'ensemble de ses contributions à la modélisation mathématique en finance, assurance, gestion des risques et informatique scientifique appliquée à la finance et aux assurances.

Damir Filipović est professeur à l'École Polytechnique Fédérale de Lausanne (EPFL), et est titulaire de la chaire SwissQuote de finance quantitative.

Sa contribution aux domaines de la finance et de l'assurance tant sur le plan théorique que pratique est exceptionnelle. Ses premières recherches portent sur les processus stochastiques et leurs applications en finance. Le travail de Damir Filipović est impressionnant par l'abondance des sujets traités et les résultats obtenus pour chaque sujet, notamment la théorie des processus affines. Il a aussi contribué de façon significative à la gestion quantitative du risque dans le secteur financier et des assurances. Damir Filipović a travaillé comme consultant scientifique auprès de l'Office Fédéral des Assurances de Suisse, pour développer le Test Solvabilité pour la Suisse, un élément déterminant du cadre réglementaire s'appliquant aux compagnies suisses d'assurance. Son travail le plus récent porte sur le risque systémique et la réglementation afférente, l'organisation des chambres de compensation pour dérivés OTC et la dynamique des taux interbancaires.

« La reconnaissance internationale de Damir Filipovic est bien établie tant dans le monde universitaire que dans le secteur financier. Son travail est un excellent exemple de la façon dont la finance quantitative peut contribuer à la gestion des risques des institutions financières et à la conception d'un cadre réglementaire efficient pour le secteur bancaire et de l'assurance. Damir porte un regard neuf et original sur les problématiques complexes auxquels sont confrontés à la fois le monde académique et celui de l'industrie financière », souligne Michel Crouhy – Président de la Fondation Natixis.

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

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

