

Paris, le 28 septembre 2017

Prix 2017 du meilleur mémoire de master de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche et l'innovation

Laurent Mignon, directeur général de Natixis, et Michel Crouhy, président de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche et l'innovation, ont remis le prix 2017 du meilleur mémoire de master à Aitor Muguruza Gonzalez, Jean-Christophe Dietrich et Hayssam Sabra.

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, la finance de marché et les méthodes numériques appliquées aux nouvelles problématiques réglementaires », note Michel Crouhy.

Les lauréats 2017 :

Le Comité Scientifique de la Fondation Natixis pour la Recherche et l'Innovation a sélectionné cette année trois lauréats parmi les 14 mémoires qui ont été soumis, provenant de 10 Masters différents situés en France, Suisse et au Royaume-Uni :

- **Aitor Muguruza Gonzalez**, du MSc in Mathematics and Finance de Imperial College, Rough Volatility: Characterisation of VIX in rBergomi and Extension to Numerical Schemes, réalisé chez Zeliade Systems.
- **Jean-Christophe Dietrich**, du Master 2 Modélisation Aléatoire M2MO de l'Université Paris VII – Diderot, Initial Margin Funding Cost for Rate products, réalisé chez Goldman Sachs.
- **Hayssam Sabra**, du Master of Science in Wealth Management de l'Université de Genève, Currency Management Methods for International Portfolios.

La Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche et l'innovation 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.

Pour les prochaines éditions du prix, il a été décidé d'étendre les thèmes de recherche et d'applications au domaine de « l'innovation digitale », « big data » et « data sciences ».

À propos de Natixis

Natixis est la banque internationale de financement, d'investissement, de gestion d'actifs, d'assurance et de services financiers du Groupe BPCE, deuxième acteur bancaire en France avec 31,2 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.

Cotée à la Bourse de Paris, elle dispose d'une structure financière solide avec un total fonds propres CET1 en Bâle 3 (1) de 12,8 milliards d'euros, un ratio CET1 Bâle 3(1) à 11,3 % et des notations long terme de qualité (Standard & Poor's : A / Moody's : A2 / Fitch Ratings : A).

(1) Sur la base des règles CRR-CRD4 publiées le 26 juin 2013, y compris compromis danois – sans mesures transitoires - sauf IDA sur pertes reportables conformément au règlement 2016/445.

Mise à jour des chiffres : 30 juin 2017

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

