

Mathématiques et Ingénierie Financière

Modèles de 2e génération pour la finance quantitative

La crise financière qui secoue le monde depuis 2007 a montré l'insuffisance et les effets négatifs des règles prudentielles (accords de Bâle II, ...) qui étaient supposées garantir la stabilité du système financier.

Une meilleure prise en compte des multiples dimensions des risques financiers est indispensable pour mieux les analyser et les contrôler.

Dans cette perspective et à partir des résultats déjà obtenus dans le cadre de son programme GRAALT (Gestion des Risques et Allocation d'Actifs de Long Terme – 2005–2008), **le Département MIF compte orienter ses activités de recherche pour le futur sur le thème : Modèles de 2e génération pour la finance quantitative qui sera articulé autour de trois directions :**

- Modèles du risque systémique
- Modèles d'évolution des corrélations (Wishart)
- Modèles structurels pour la finance durable (crédit, ...)