

Appel à projets 2015

Institut Europlace de Finance (EIF)

Paris, le 15 juillet 2015

Fondation reconnue d'utilité publique depuis 2005, l'Institut Europlace de Finance a pour ambition de mettre en œuvre et d'accélérer les synergies entre la recherche/formation en matière d'économie et de finance, et les professionnels de la Place financière. Les fondateurs de l'Institut se sont engagés à se donner, dans la durée, les moyens d'une telle action.

Comme les années précédentes, la Fondation lance en 2015 un appel à projets de recherche. Cet appel s'adresse à l'ensemble de la communauté académique concernée sans aucune restriction en termes de disciplines académiques.

La Fondation en partenariat avec le LABEX Louis Bachelier, se propose de financer 15 projets de recherche, qui bénéficieront pour chacun d'un financement de 10 000 €.

Les projets financés porteront sur des thématiques considérées d'intérêt majeur dans le contexte actuel et regroupées en 4 axes (voir également l'annexe jointe):

- ◆ Réglementation et environnement financier
- ◆ Taux d'intérêt
- ◆ Risk management
- ◆ Investissement

Les projets devront impliquer au moins un chercheur affilié à une institution académique française. Les projets impliquant plusieurs équipes, et notamment ceux présentant une réelle dimension européenne, seront étudiés avec un intérêt tout particulier.

En faisant acte de candidature, les porteurs de projet, s'engagent s'ils sont sélectionnés, à développer leur projet en lien (rencontres, échanges avec les équipes) avec un ou plusieurs acteurs de la place financière de Paris. Le cas échéant, les réponses à l'appel à projets pourront faire état de liens déjà existants et susceptibles d'être renforcés dans le cadre du projet.

La date limite de soumission des dossiers de candidature à cet appel d'offres est fixée au **20 septembre 2015**.



Elyès JOUINI
Directeur scientifique
Institut Europlace de Finance

Pour plus d'informations :
info@europlace-finance.com

Appel à projets 2015

Thématiques

INSTITUT
EUROPLACE
DE FINANCE

Louis Bachelier

LABEX

Louis Bachelier

Réglementation et environnement financier

- Bilan des réglementations post-crise (efficacité, changements induits en matière de comportements, stratégies de contournement, shadow banking,...)
- Fondements micro (modèles prédictifs sur les contrats et sur les comportements) des projections macro
- Big data et assurance, concentration de l'information et construction potentielle de positions dominantes

Taux d'intérêt

- Changements structurels induits par les taux bas (impact économique, valorisation des options, trading,...)
- Modèles de taux incluant la possibilité de taux bas (voire négatifs) durables
- Taux bas, absence d'inflation et investissement notamment dans les secteurs de très long terme (énergie, infrastructures,...)
- Taux bas et Solvency II
- Assurance vie, taux bas et longévité
- Design de produits d'assurance dans un contexte de taux bas et prise en compte du triptyque profitabilité/risque/fairness, gestion de la couverture
- Comportement des assurés en situation de taux bas et prise en compte de leur rationalité croissante
- Variable annuities

Risk management

- CVA, DVA
- RWA, impact sur la liquidité, évaluation du coût du capital, comment intégrer le coût du capital dans le pricing ?
- Risk management et changements structurels (évolutions réglementaires et nouveaux comportements)
- Gestion du gap de duration sous Solvency II et mise en cohérence de cadres réglementaires divergents (IFRS, Solvency II,...)
- Volatilité long terme, modélisation, mesure, couverture de long terme
- Scénarios de stress sur les crédits hypothécaires (sur données françaises et européennes) en lien avec la transition démographique, structure des risques

Investissement

- Financiarisation des brevets, financement de la propriété intellectuelle
- Transformation des modèles de financement
- Taux bas, absence d'inflation et investissement notamment dans les secteurs de très long terme (énergie, infrastructures,...)

2015