

## François Longin - L'innovation financière

François Longin poursuit une carrière dans le domaine de la banque et de la finance en alliant recherche, conseil et formation.

Diplômé de l'Ecole Nationale des Ponts et Chaussées en 1990, il obtient son doctorat en finance à HEC en 1993. Sa thèse traite des mouvements extrêmes des marchés financiers tels que les krachs boursiers. Il est aussi titulaire d'un DEA de Probabilité de Paris VI et agrégé de mathématiques. Après ses études, il a mené des recherches sur la volatilité des marchés financiers à l'Université de New York (NYU Stern Business School) et à la London Business School.



Ses travaux de recherche portent principalement sur les événements extrêmes en finance et sur les applications financières de la théorie des valeurs extrêmes : la distribution statistique des rentabilités extrêmes, les dépôts de garantie sur les marchés dérivés, l'impact de la réglementation financière sur la volatilité des marchés financiers, l'amélioration des techniques de gestion de portefeuille en période de crise, le calcul de la *value at risk* (VaR) de positions de marché, la définition de scénarios catastrophe pour le *stress testing*... Ses travaux de recherche ont trouvé des applications dans le domaine de la gestion des risques bancaires (marchés, crédit et opérationnel). En 1996, il reçoit le prix de la bourse américaine Chicago Board of Trade pour sa recherche sur les produits dérivés. Ses travaux ont été publiés dans des journaux scientifiques internationaux comme *The Journal of Finance*, *Journal of Business*, *Review of Financial Studies*, *Journal of Banking and Finance*, *Journal of International Money and Finance*, *Journal of Futures Markets*, *Journal of Derivatives* et *Journal of Asset Management*.

Pendant plusieurs années, il est en charge de la direction de la recherche et de l'innovation dans un grand groupe bancaire international où il encadre une équipe d'ingénieurs financiers travaillant pour les salles de marchés et les sociétés de gestion. Son domaine d'expertise et de conseil couvre la gestion des risques pour les institutions financières, la gestion de portefeuille pour les sociétés de gestion, la gestion financière pour les entreprises et la gestion de patrimoine pour les particuliers. François Longin est aussi professeur de finance à l'ESSEC et il anime le réseau professionnel FinLink spécialisé dans les secteurs Banque Assurance Finance.

Pour plus d'information, visiter le site [www.longin.fr](http://www.longin.fr)