

SEMINAIRE MATHÉMATIQUES ET SOCIÉTÉ

**Mercredi 23 novembre 2016
à 16h15**

**Auditoire Louis-Guillaume,
ALG, F200**

**Conférencier : Dr. Akimou Ossé
QuantPlus**

« *Mathématiques de la contagion financière* »

Résumé : A défaut d'une définition officielle, nous allons considérer qu'une contagion financière est une perturbation des marchés financiers qui conduit à des défaillances en chaîne d'institutions financières. Depuis la crise de 2008, ce phénomène est au centre de l'attention de tous les acteurs de la finance et surtout du Conseil de Stabilité Financière (CSF), l'organisme créé en 2009 pour coordonner la réglementation et la surveillance des marchés financiers au niveau mondial. Suivant la CSF, une bonne analyse de la contagion financière doit absolument tenir compte non seulement de la taille et de la complexité de chaque institution, mais aussi des liens entre chacune et les autres composantes du système financier (interconnectivité). De nombreux modèles conformes aux recommandations de la CSF ont été développés ces dernières années. Ils sont basés sur la théorie mathématique des graphes et s'inspirent d'autres domaines scientifiques (écosystèmes naturels en biologie, réseaux de distribution électriques, l'algorithme PageRank de Google, etc.) L'objectif est de présenter quelques uns de ces modèles en mettant l'accent sur les outils mathématiques utilisés.

Organisation : Paul Jolissaint
Institut de Mathématiques
Emile-Argand 11
CH – 2000 Neuchâtel