

Appel à projets de recherche 2012

Résultats

L'Institut a le plaisir d'annoncer les projets de recherche retenus pour l'appel de 2012.

Migration of OTC derivatives to CCP in the Canadian market

Jorge Cruz Lopez, Analyste principal, Banque du Canada
Christophe Hurlin, Professeur en économie, Université d'Orléans
Christophe Pérignon, Professeur agrégé, HEC Paris

Montant accordé: 75 000 \$

Liquidity in the securitized product market

Rainer Jankowitsch, Professeur agrégé, WU – Vienna University of Economics and Business
Nils Friewald, Professeur adjoint, WU – Vienna University of Economics and Business
Marti G. Subrahmanyam, Professeur titulaire, New York University

Montant accordé: 75 000 \$

Pricing and using longevity risk instruments

Martin Boyer, Professeur titulaire, HEC Montréal
Lars Stentoft, Professeur agrégé, HEC Montréal
Christian Dorion, Professeur adjoint, HEC Montréal

Montant accordé: 40 000 \$

Pricing, hedging and valuing derivatives

Michèle Breton, Professeur titulaire, HEC Montréal

Montant accordé: 40 000 \$



Valuation of banks' commitments

Zvi Wiener, Professeur agrégé, The Hebrew University of Jerusalem
Dan Galai, Professeur, The Hebrew University of Jerusalem

Montant accordé: 40 000 \$

Multi-curve Libor market model with interest rate modeled as a random field

Tao L. Wu, Professeur adjoint, Illinois Institute of Technology

Montant accordé: 15 000 \$