

LAUSANNE

L'EPFL lance son master en finance

ALEXANDRE SONNAY

L'Ecole polytechnique fédérale de Lausanne (EPFL) va accueillir cette année la première volée du master en ingénierie financière. Peter Bossaerts, professeur au Collège du management de la technologie et spécialiste en finance comportementale, ainsi que Martin Vetterli, vice-président des relations internationales, ont levé le voile la semaine passée sur ce programme.

«Nous allons nous éloigner d'un enseignement traditionnel pour répondre aux nouveaux défis dans la finance et la gestion du risque», ont-ils lancé. Et pour cause. Les difficultés qu'ont rencontrées les marchés financiers depuis l'été passé ont en effet montré les limites des modèles jusque-là utilisés dans l'industrie financière. Ceux-ci ont sous-estimé la probabilité d'événements de très grande ampleur.

«Et pourtant, des techniques ont été développées, notamment par les assureurs dans le cas de catastrophes naturelles, pour prendre en compte ce type de situation extrême», précise l'ancien chercheur à Caltech. Pourquoi alors n'ont-ils pas été intégrés par

l'industrie de la finance? «Ce sont des techniques encore peu répandues», explique Peter Bossaerts. «De plus, la formation fait défaut», renchérit Martin Vetterli.

Ce nouveau master veut justement combler ce vide et va combiner un enseignement de base en finance et des disciplines qui ne sont pas encore intégrées dans des cursus traditionnels. La formation comprendra un travail de 6 mois en entreprise. «Un projet très bien accueilli par notre comité d'experts, regroupant des représentants de Swiss Re ou de Lombard Odier Darier Hentsch», ajoute Martin Vetterli.

Qu'en est-il de la coopération avec HEC et le Swiss Finance Institute (SFI)? «Ce master s'adresse à des personnes tout à fait différentes. Nous visons un public ayant un important bagage analytique, tel que des ingénieurs en mathématiques ou en physique, mais qui n'ont peu, voire pas du tout, de connaissances en finance», précise Peter Bossaerts, également professeur au SFI. Par contre, le programme de doctorat se fera en étroite collaboration entre le SFI et l'EPFL. |

AGEFI