

Mathieu Gatumel

Université de Savoie
IUT Chambéry - Département GACO
IREGE

mathieu.gatumel@univ-savoie.fr
<http://gatumel.ensae.net>

Expériences professionnelles

- **Septembre 2013 - : Maître de Conférences à l'Université de Savoie**
 - Enseignements : responsable des modules d'analyse financière, de contrôle de gestion et de management de projets. (Niveau L1 et L2)
 - Responsable des projets tutorés.
- **2010 - 2013 : PRAG à l'IUT2 de Grenoble, Département Informatique.**
 - Enseignements : responsable des modules d'Introduction aux mécanismes économiques, de Notions fondamentales de Gestion, de Jeu d'entreprise, de Création d'entreprise, de et co-responsable du module de Fonctionnement d'entreprise. (Niveau L1 à L3).
- **2009-2010 : Professeur agrégé d'économie-gestion, en classe de première de Sciences et Technologies de la Gestion (STG), à Villeurbanne.**
- **Septembre 2005 - Août 2009 : Chargé d'études actuarielles, Axa, Group Risk Management, Paris.**
 - *Capital Economique et Valeur* :
 - Développement d'un nouveau cadre pour les calculs de profitabilité et de rentabilité en assurance non-vie : participation à la définition générale de la métrique, détermination du coût du capital pour les risques non-vie du groupe, étude de sa diversification et de son allocation.
 - En charge de groupes de travail sur les modélisations des cycles de marché en assurance et du comportement du souscripteur dans sa politique de tarification.

Formation

- 2006-2009 Thèse de doctorat sur la valorisation du risque en assurance non-vie.**
Obtenue avec mention très honorable et les félicitations du jury à l'unanimité.
Directeur, Mme Dominique Guégan, Professeure à l'Université Paris Panthéon Sorbonne. Laboratoire, Centre d'Economie de la Sorbonne. Contrat Cifre en collaboration avec Axa.
- 2005 3ème année de l'Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economique (ENSAE).** Spécialisation en Finance-Actuariat.
DEA Finance et Econometrie, Université Paris II Panthéon Assas.
- 2004 Agrégation d'économie et gestion,** option gestion comptable et financière.
Reçu deuxième.
- 2001–2005 Ecole Normale Supérieure de Cachan.**

Publications

- *Commodity markets through the business cycle*, 2013, avec J. Chevallier et F. Ielpo. *Quantitative Finance*, forthcoming.
- *Understanding momentum in commodity markets*, avec J. Chevallier et F. Ielpo. *Applied Economics Letters*, 20(15) :1383-1402.
- *Understanding and Monitoring the Reinsurance Counterparty Risk*, 2013, avec S. Lemoyne Deforges. *Bulletin Français d'Actuariat*, vol. 13(26), pp. 121-138.
- *The Number of Regimes Across Asset Returns : Identification and Economic Value*, 2011, avec F. Ielpo. 2ème révision en cours.
- *Measuring Risk Appetite from Financial Assets' Returns*, 2013, avec F. Ielpo. En révision.
- *Measuring Risk Appetite from Financial Assets' Returns*, 2013, avec F. Ielpo. En révision.
- *Is the Insurance Cost-of-Capital Fair ?*, 2011. Document de recherche du centre d'économie de la Sorbonne.
- *Dynamic Analysis of the Insurance Linked Securities Index*, 2008, avec D. Guégan. Document de recherche du Centre d'Economie de la Sorbonne.
- *Towards an Understanding Approach of the Insurance Linked Securities Market*, 2008, avec D. Guégan. Document de recherche du Centre d'Economie de la Sorbonne.

Communications et autres activités scientifiques

- JE : *Measuring Risk Appetite from Financial Assets' Returns* 11ème journée d'économétrie « Développements récents de l'économétrie appliquée à la finance », November 21, 2012, University of Paris West Nanterre, France.
- SGF'12 : *The Number of Regimes Across Asset Returns : Identification and Economic Value*. 15th Annual Conference of the Swiss Society for Financial Market Research, March 30, 2012, Zürich, Switzerland.
- CFE'11 : *The Number of Regimes Across Asset Returns : Identification and Economic Value*. 5th International Conference on Computational and Financial Econometrics, December 17-19, 2011, University of London, UK.
- JE : *The Number of Regimes Across Asset Returns : Identification and Economic Value*. 10ème journée d'économétrie « Développements récents de l'économétrie appliquée à la finance », November 23, 2011, University of Paris West Nanterre, France.
- ISF : *Identifying and Explaining the Number of Regimes Driving Asset Returns*. 31st Annual International Symposium on Forecasting, June 24-27, 2011, Prague, Czech republic.
- FFM : *The Number of Regimes Driving Financial Markets*. 18th Forecasting Financial Markets Conference, May 25-27, 2011, Marseille, France.
- ASTIN : *Towards an Understanding Approach of the Insurance Linked Securities Market*. 38th ASTIN Conference, July 13-16, 2008, Manchester, UK.
- GDRE : *Towards an Understanding Approach of the Insurance Linked Securities Market*. 25th International Symposium on Money, Banking and Finance, June 18-20, 2008, Luxembourg.
- ICA : *Valorisation du risque IARD et nouvelles normes comptables*. 28th International Congress of Actuaries, May 28 - June 2, 2006. Paris
- Rapporteur pour les revues *Journal of Banking and Finance*, *The European Journal of Finance*, *Annales d'Economie et de Statistique* et *Finance, Contrôle et Stratégie*.