

# La mathématicienne française du jour



## Nicole El-Karoui

Née à Paris en 1944

### Thème de recherche

Processus stochastiques

### Biographie

Élève de l'ENSJF(1964)

Professeur de mathématiques à l'Université du Maine, à l'ENS de Fontenay, à Paris VI et à l'École Polytechnique

Ses recherches qui se sont déroulées pour une grande part au Laboratoire de Probabilités de Paris VI portent d'abord sur les processus stochastiques puis sur les outils théoriques du contrôle stochastique.

En 1989, à la suite d'un semestre sabbatique dans la banque, elle s'intéresse aux mathématiques financières, tant du point de vue pratique que théorique, ce qui est maintenant son domaine de recherche principal.

La même année, avec H. Geman, elle crée à Paris VI en cohabilitation avec l'École Polytechnique le parcours finance du Master Probabilités et Applications. La formation rencontre très rapidement un grand succès et a très largement contribué à la visibilité des « quants français » dans les salles de marché

C'est aujourd'hui un des chefs de file de l'école française de mathématiques financières.