

### Didier Maillard - Professeur émérite

#### Thématiques de recherche

Gestion d'actifs (asset management)  
Gestion de patrimoine  
Gestion du risque - modélisation du risque extrême  
Economie du risque  
Analyse économique et financière de la fiscalité

Contactez Didier Maillard

[didier.maillard@cnam.fr](mailto:didier.maillard@cnam.fr)

#### Parcours de Didier Maillard

Didier Maillard est diplômé de l'Ecole polytechnique et de l'Ecole nationale d'administration. Il a commencé sa carrière comme économiste à la direction de la prévision du ministère de l'économie et des finances, dont il a été sous-directeur, et à l'OCDE. Il a ensuite été directeur des études économiques et financières de la banque Paribas, co-responsable de Paribas Asset Management et a développé des activités de risk advisory à Paribas Capital Markets. Il a rejoint le Cnam en 2001 comme professeur, titulaire de la chaire de Banque. Il y a créé et dirigé un DESS devenu Master de gestion internationale de patrimoine, et développé des actions de formation à destination d'un grand groupe bancaire.

#### Sélection des publications marquantes ou récentes

Option Pricing under Skewness and Kurtosis using a Cornish Fisher Expansion, Journal of Futures Markets, December 2016, vol. 36 n°12, pp. 1194-1209 (avec Sofiane Aboura)  
Portfolio Optimization under Tracking Error and Weight Constraints, The Journal of Financial Research, Summer 2011 (avec Isabelle Bajoux-Besnainou, Riad Belhaj et Roland Portait)  
Gestion contre benchmarks et contraintes sur le tracking error ex ante et ex post, Banques & Marchés n° 79, novembre-décembre 2005 (avec Riadh Belhaj et Roland Portait)  
LA Users'Guide to the Cornish Fisher Expansion, SSRN Working Papers series n°1997178, 2012-2014, 1600 téléchargements.

[Revenir à la liste des membres](#)



## En savoir plus

+ [Consulter les travaux de Didier Maillard](#)

<https://lirsa.cnam.fr/le-laboratoire/membres/didier-maillard-professeur-emerite--982730.kjsp?RH=1337076011992>