



ÉCONOMIE, FINANCE, CONTRÔLE & DROIT

Fei LiuProfesseure Assistante en Finance

Contact

Email: fei.liu@ipag.fr

Téléphone: +33 1 5363 3600

Campus: Paris

Biographie

Fei Liu est professeure assistante en finance, avec un fort intérêt de recherche dans la modélisation des séries temporelles financières. Fei se concentre sur l'application pragmatique des résultats scientifiques aux défis du monde réel dans le trading algorithmique et la gestion des risques. De plus, ses recherches explorent les intersections entre l'Intelligence Artificielle (IA), les facteurs Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG), ainsi que la finance durable. Un axe clé de ses travaux porte sur le rôle de l'IA dans la prise de décision financière, l'intégration des considérations ESG dans les modèles quantitatifs et les implications de la durabilité sur la stabilité financière et les stratégies d'investissement.

Éducation

• Doctorat en Mathématiques

2014 – 2018, Université de Liverpool, Royaume-Uni.

Projet : Modélisation et prévision de la volatilité stochastique sur les marchés boursiers.

• Master of Philosophy (MPhil) en Mathématiques

2011 – 2013, Université de Liverpool.

Projet : Modélisation des risques en assurance et finance, identification des rôles des risques en assurance et finance dans les probabilités de ruine, détermination des mesures de risque.

- Licence en Mathématiques 2007 – 2011, Université de Liverpool.
- Réussite des examens préliminaires de la Society of Actuaries (SOA), incluant : Probabilité, Mathématiques financières, Modèles pour l'économie financière, Modèles pour les contingences de vie, Construction et évaluation de modèles actuariels.
- Projet pour obtenir la requalification du doctorat en économie auprès du ministère français compétent.

Teaching Areas

- Statististique
- Probabilité
- Investment Management
- Quantitative Finance
- Financial Markets
- Risk Management

Research Areas

- Econométrie
- Trading Algorithmique
- Modélisation de Volatilité

Professional experiences

 Professeur Assistant, IPAG Business School, Paris, 2019 - Présent (Enseignement moyen de 200 à 300 heures par an ces trois dernières années. Les notes de satisfaction, lorsqu'elles sont disponibles, sont mentionnées.) Cours enseignés: Statistiques, Finance quantitative, Gestion des risques, Finance internationale, Gestion de patrimoine, Python pour la finance, etc.

- Vacatataire, EISTI CyTech, Cergy, 2019-2021
 Cours: FinTech, RegTech et InsurTech.
- Assistant Pédagogique, Université de Liverpool, Royaume-Uni, 2014 2016
 Cours : Statistiques, Probabilité, Mathématiques financières.
- Stagiaire en Gestion, China Merchants Bank, Chine, 2013 2014

Selected publications

- 1st revision submitted. MCDA Strategies for Portfolio Optimization: A Case Study on Vietnamese Stock Market Dynamics. Annals of Operations Research. 2025.
- 1st revision submitted. Influence of Social Sustainable Development Goals Sentiment on Listed Companies. Research in International Business and Finance, Special Issue on Social Finance. 2025.
- Portfolio management with ESG news sentiment. Bankers, Markets, and Investors. 2024 (FNEGE 4) DOI:10.54695/bmi.172.0072
- Sustainable Investing, Chapitre 13: Portfolio Management with News-Based Sustainability Scores, pp. 337-374.
 Ron Große, Viet Hoang Le, Fei Liu, Hans-Jörg von Mettenheim. World Scientific Publishing. 2024. DOI: 10.1142/9789811297786_0013
- Analysis of the Relevance of Sentiment Data for the Prediction of Excess Returns in a Multi-Asset Framework (avec Desforges P, Geissler C). Journal of Forecasting. 2023. (FNEGE 3, ABS 2*) DOI: 10.1002/for.2967
- Deep Learning and Technical Analysis in Cryptocurrency Markets (avec Goutte S, Le VH, v. Mettenheim HJ). Finance Research Letters. 2023. (FNEGE 3, ABS 2*) DOI: 10.1016/j.frl.2023.103809
- News-based Sentiment: Can It Explain Market Performance Before and After the Russia-Ukraine Conflict? (avec Le VH, v. Mettenheim HJ, Goutte S). Journal of Risk Finance. 2022. (ABS 1*) DOI: 10.1108/JRF-06-2022-0168
- Pricing Inefficiencies and Feedback Trading: Evidence from Country ETFs (avec Kallinterakis V, Shao J).
 International Review of Financial Analysis. 2020. (FNEGE 3, ABS 3*) DOI: 10.1016/j.irfa.2020.101498
- Forecasting and Trading High Frequency Volatility on Large Indices (avec v. Mettenheim HJ). Quantitative Finance. 2018. (FNEGE 3, ABS 3*) DOI: 10.1080/14697688.2017.14144489
- Ruin with Insurance and Financial Risks Following the Least Risky FGM Dependence Structure (avec Chen Y, Liu J). Insurance: Mathematics and Economics. 2015. (FNEGE 3, ABS 3*) DOI: 10.1016/j.insmatheco.2015.03.007