

Elise GOURIER

Professeur associé

gourier@essec.edu

Département: Finance

Campus de Cergy

DIPLÔMES

DIPLÔMES

2013 Ph.D. en Finance
(University of Zurich Suisse)

CARRIÈRE

POSITIONS ACADÉMIQUES PRINCIPALES

2018 - 2021-08-31 Professeur assistant (ESSEC Business School France)

2015 - 2017-07-31 Professeur Assistant en Finance (Université Queen Mary Royaume-Uni)

2021 - Présent Professeur associé (ESSEC Business School France)

AUTRES POSITIONS

2013 - 2015-08-31 Post-Doctoral Fellow, Département de Recherche des Opérations et Ingénierie
Financière (ORFE) (Princeton University États-Unis)

AUTRES POSITIONS ACADÉMIQUES

2025 - 2026-08-31 Co-responsable de chaire ESSEC Shaping the Future of Finance (ESSEC
Business School France)

2026 - 2026-08-31 Co-responsable de la chaire ESSEC-Amundi Chair on Asset & Risk
Management (ESSEC Business School France)

PUBLICATIONS

ARTICLES

[BARDGETT, C., GOURIER, E. et LEIPPOLD, M. \(2019\). Inferring volatility dynamics and risk-premia from the S&P500 and VIX markets. *Journal of Financial Economics*, 131\(3\), pp. 593-618.](#)

[FILIPOVIC, D., GOURIER, E. et MANCINI, L. \(2016\). Quadratic Variance Swap Models. *Journal of Financial Economics*, 119\(1\), pp. 44-68.](#)

[DRIMUS, G., FARKAS, W. et GOURIER, E. \(2016\). Valuation of options on discretely sampled variance: A general analytic approximation. *Journal of Computational Finance*, 20\(2\), pp. 39-66.](#)

[FARKAS, W., GOURIER, E., HUITEMA, R. et NECULA, C. \(2017\). A two-factor cointegrated commodity price model with an application to spread option pricing. *Journal of Banking & Finance*, 77\(C\), pp. 249-268.](#)

[GOURIER, E., PHALIPPOU, L. et WESTERFIELD, M.M. \(2024\). Capital Commitment. *Journal of Finance*, 79\(5\), pp. 3407-3457.](#)

COMMUNICATIONS DANS UNE CONFÉRENCE

[GOURIER, E., PHALIPPOU, L. et WESTERFIELD, M. \(2023\). Capital Commitment. Dans: 2023 American Finance Association \(AFA\) Annual Meeting. Nouvelle-Orleans.](#)

[GOURIER, E., PHALIPPOU, L. et WESTERFEILD, M. \(2023\). Capital Commitment. Dans: 2023 Toulouse Financial Econometrics Conference. Toulouse.](#)

[GOURIER, E. et IUNG MATHURIN, H. \(2024\). A Greenwashing Index. Dans: 3rd Spring Finance Workshop 2024. Ischgl.](#)

[GOURIER, E. et IUNG MATHURIN, H. \(2022\). A Greenwashing Index. Dans: 16th International Conference Computational and Financial Econometrics 2022. London.](#)

[GOURIER, E. et IUNG-MATHURIN, H. \(2023\). A Greenwashing Index. Dans: 5th International Workshop in Financial Econometrics 2023. Santo André \(Bahia\).](#)

[GOURIER, E. \(2024\). Greenwashing: How does it impact financial markets? Dans: Science & Society 2024. Cergy.](#)

INTERVIEWS : EMISSION RADIO - TV - PRESSE ÉCRITE

[GOURIER, E. 2024. *New Study: What's holding back sustainable funds? Greenwashing*. Février.](#)

ACTIVITÉS DE RECHERCHE

Membre d'un comité de lecture

2024 - Présent: Co-rédacteur en chef - Journal of Financial Econometrics