

Curriculum Vitae - Areski COUSIN

Né le 14 mars 1981
Marié, sans enfant
Nationalité française
2, rue du Colonel Candelot
92 340, Bourg-la-Reine
☎ 06 63 80 49 65 / 01 80 93 06 40

Université d'Evry-Val-d'Essonne,
Département de Mathématiques,
rue Jarlan, 91 025 Evry Cedex
✉ areski.cousin@gmail.com
🌐 <http://www.acousin.net>
☎ 01 69 47 02 26



Formation

- 2005-2008** - Doctorat de sciences de gestion effectué au laboratoire SAF (Sciences Actuarielle et Financière), Université Lyon 1, dirigée par le Professeur Jean-Paul LAURENT :
Analyse du Risque et Couverture des Tranches de CDO Synthétique.
Thèse soutenue le 17 Octobre 2008, mention très honorable avec les félicitations du jury, devant le jury suivant :
- François QUITTARD-PINON, Professeur à l'Université Lyon 1
Monique JEANBLANC, Professeur à l'Université d'Evry
Franck MORAUX, Professeur à l'Université de Rennes 1
Claude LEFÈVRE, Professeur à l'Université libre de Bruxelles
Emmanuel GOBET, Professeur à l'ENSIMAG, InP Grenoble
Jean-Paul LAURENT, Professeur à l'Université Lyon 1
- 2004-2008** - Diplôme d'actuaire de l'ISFA obtenu le 29 Septembre 2008, Université Lyon 1
- Master 2 Recherche Science Actuarielle et Financière, mention Très Bien, ISFA, Université Lyon 1
- Master 2 Professionnel Science Actuarielle et Financière, mention Bien, ISFA, Université Lyon 1
- 2003-2005** - Diplôme d'ingénieur ENSIMAG obtenu le 23 Septembre 2005, mention Bien, Grenoble
- 2000-2002** - CPGE Maths-Physique, lycée Masséna, Nice
- 1999** - BAC S, lycée Masséna, Nice

Expériences professionnelles

- 2008-2009** - **Post-doctorant à l'Université d'Evry-val-d'Essonne**, partenaire du projet [CRIS](#), agréé par le pôle de compétitivité finance et innovation. Ce projet a donné naissance au consortium CRIS regroupant les entreprises Zeliade Systems, OTC conseil, JPLC conseil, Dexia CL, Microsoft France et de l'Université d'Evry. Il a pour but de rassembler des compétences à la fois industrielles et académiques afin de développer une plateforme indépendante et transparente de gestion des risques des produits dérivés de crédit.
- Été 2007** - **BNP-Paribas** Fixed Income Research Team, Londres. Implémentation et calibration du modèle décrit dans l'article *Hedging default risk of CDOs in Markovian contagion models*
- 2005-2006** - **Adding Actuaire conseil**, Lyon, Consultant scientifique. Développement d'un modèle d'évaluation des stocks-options intégrant le phénomène d'exercice anticipé
- 2005-2008** - **Allocataire de recherche à l'Université Lyon 1**
- Avril-Août 2005** - **Adding Actuaire conseil**, Lyon. Stage d'actuaire. Évaluation et comptabilisation des Stock-Options à travers la norme IFRS 2
- Été 2004** - **WIMBA**, Sophia-Antipolis. Stage d'ingénieur. Développement en JAVA d'outils de tests statistiques pour un serveur web vocal et optimisation de la base de donnée

Recherche, Articles

- 2008 - Cousin, A. and J-P Laurent, 2008, *Hedging issues for CDOs*, paru dans le livre *The Definitive Guide to CDOs* édité par Gunter Meissner
- Cousin, A. and J-P Laurent, 2008, *An overview of factor models for pricing CDO tranches*, paru dans le livre *Frontiers In Quantitative Finance* édité par Rama Cont
- 2007 - Laurent, J-P., A. Cousin and J-D Fermanian, 2007, *Hedging default risk of CDOs in Markovian contagion models*, working paper
- Cousin, A. and J-P Laurent, 2007, *Comparison results for exchangeable credit risk portfolios*, paru dans *Insurance : Mathematics and Economics*
- 2006 - Cousin, A., 2006, Valorisation et comptabilisation des stock-options à travers la norme IFRS 2, Mémoire de Master 2 Recherche

Présentations, Séminaires

- 2008 - Séminaire Finance, IGR/IAE, Université Rennes 1, 25 Novembre 2008
- Groupe de travail - Chaire Risque de Crédit, Université d'Evry, 9 Octobre 2008
- Groupe de travail - Projet Ast&Risk, ISFA, Université Lyon 1, 26 Septembre et 10 Octobre 2008
- AFFI 2008 Annual Meeting, Lille School of Management, Lille, 20-22 Mai 2008
- Groupe de travail - Chaire Risque de Crédit, Université d'Evry, 31 Janvier 2008
- Groupe de travail - Chaire Risque de Crédit, Université d'Evry, 17 Janvier 2008
- 2007 - AFFI International Meeting, Paris, 20 Décembre 2007
- Séminaire Lyon-Lausanne, HEC Lausanne, 26 Novembre 2007
- Séminaire Bachelier - "Demi-journée doctorant", Paris, 22 Juin 2007
- Journées Inter-universitaires de Recherche en Finance, Université de Bourgogne, Dijon, 31 Mai 2007
- 2006 - Séminaire "Monnaie-Banque-Finance-Assurance", ENS Cachan, 20 Décembre 2006
- Séminaire Lyon-Lausanne, ISFA, Lyon, 11 Décembre 2006

Charge d'Enseignement

- 2008 - Risque de crédit, ENSIMAG 3^{ème} année, filière mathématiques financières, Octobre-Décembre 2008 (20h)
- Économie Monétaire, Licence 3, National Economics University, Hanoi, Vietnam, Avril 2008 (20h)
- Introduction au risque de crédit, Master 1 ISFA, Université Lyon 1, Mars 2008 (4h)
- Description, évaluation et couverture des tranches de CDO, Master 2 Recherche, ISFA, Université Lyon 1, Février 2008 (8h)
- 2007 - Risque de crédit, Master 2 Recherche, ISFA, Université Lyon 1, Mars 2007 (8h)
- Économie du Risque, Master 1, Economics University of Ho Chi Minh City, Vietnam, Avril 2007 (20h)

Connaissances informatiques

Langages C/C++, Xll Excel add-in, Visual Basic, Matlab, R/S+, SAS Java, HTML, SQL, L^AT_EX

Logiciels Visual C++, Matlab, Scilab, SAS, Maple, Microsoft Office

Langues et Centres d'intérêts

Anglais courant, plusieurs séjours au Royaume-Uni et aux États-Unis

Italien notion

Intérêts voyages, jeux de société, squash

Musique - Accordéon de concert - Classique et Jazz - plusieurs concours nationaux remportés, participation à des concours internationaux

- Tuba - Formation musicale au Conservatoire de Nice, plusieurs participations à l'harmonie municipale de Nice