

Adresse professionnelle :

ISFA, Université Lyon 1
50 av. Tony Garnier, 69007 Lyon

✉ areski(dot)cousin(at)univ-lyon1(dot)fr

🌐 <http://www.acousin.net>

☎ 04 37 28 74 39



Situation actuelle

Maître de Conférences à l'ISFA, Université Lyon 1, depuis le 1^{er} Septembre 2009

Formation

2008-2009 - Post-doctorant à l'Université d'Evry-val-d'Essonne, laboratoire de Mathématiques, sous la responsabilité du Professeur Monique JEANBLANC

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

Prix de thèse Euronext-AFFI-PRMIA 2008

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

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.

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

Ma recherche concerne les thématiques suivantes :

- Modélisation du risque d'un portefeuille de crédit
- Couverture de tranches de CDO synthétique
- Mesures de risques multivariées

Recherche, Articles, Contributions à des Ouvrages

- 2009
- Cousin, A., M. Jeanblanc, et J-P Laurent, *Hedging of CDO tranches*, Chapitre de livre en cours de soumission chez Springer, dans la collection *Paris-Princeton lectures on Mathematical Finance*.
 - Cousin, A., *A tree-based approach to price leverage super-senior tranches*, working paper
 - Cousin, A., S. Crépey, J-D Fermanian, A. Herbertsson, and J-P Laurent, *Hedging CDO tranches in a bottom-up model with simultaneous defaults*, working paper.
 - Cousin, A., S. Crépey, J-D Fermanian, A. Herbertsson, and J-P Laurent, *Managing bespoke tranches*, working paper.
 - Cousin, A. et S. Crépey *Hedging of synthetic CDO tranches using two alternative strategies*, working paper.
- 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

- 2009
- Recent advancement in the theory and practice of credit derivatives, Nice, 30 Septembre 2009
 - Workshop on copula theory and its applications, Varsovie, 26 Septembre 2009
 - Réunion projet Ast&Risk, Ensimag, Grenoble, 31 Août 2009
 - CRIS research meeting, Paris, 5 June 2009
 - Second International Financial Research Forum, Paris, 19 Mars 2009
 - Groupe de travail - Chaire Risque de Crédit, Université d'Evry, 12 Mars 2009
 - Présentation des mémoires d'actuariat de qualité organisé par l'institut des actuaires, CNP Assurance, Paris, 13 Février 2009
- 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, Hanoï, 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