

✉ 23-25 rue Letellier
75015 PARIS

☎ 06 15 17 75 37

💻 christophe.lunven@gmail.com

Christophe LUNVEN

Ingénieur Financier

FORMATION

| | |
|-----------|--|
| 2003-2005 | Statisticien Economiste, Actuaire, ENSAE (<i>voie finance et actuariat</i>) |
| 2000-2003 | Ingénieur Ecole Centrale de Lyon (<i>opt. Maths Appliquées aux Sciences de l'Ingénieur</i>) <i>Licence de Mathématiques, en 2001, Université Lyon I</i> <i>DEUG Economie, en 2002, Université Lumière Lyon II</i> |
| 1997-2000 | Mathématiques Supérieures MPSI et Spéciales MP* au Lycée Kerichen à Brest |
| 1997 | Baccalauréat S (<i>mention Bien</i>) au Lycée Kerichen à Brest |

EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

| | |
|------------------|---|
| Depuis Déc.08 | BNP Paribas Personal Finance - ALM - Responsable Equipe Modèles Financiers <i>Modélisation comportementale et financière</i> <i>Stratégies de couverture de risque de taux et de change</i> <i>Définition / validation de méthodes de provisionnement IAS</i> |
| juil. 05/Déc.08 | BNP Paribas - CIB - ALM - Equipe Modèles Financiers <i>Modélisation comportementale (Epargne logement, remboursement anticipés de crédits)</i> <i>Pricing d'options financières (produits exotiques de taux) et d'options cachées (PEL, crédits)</i> <i>Implémentation de modèles de simulation taux/inflation (MLG2+, CIR2+, HJM vol. sto.)</i> <i>Simulations de Monte Carlo, Stress Testing et mesure de Capital Economique sur banking book</i> <i>Couverture du risque de taux sur portefeuilles de crédits et d'options</i> <i>Structuration (taux/change/inflation) de crédits immobiliers pour UCB, évaluation du risque de crédit</i> |
| Oct.04 – Juin 05 | Finance Concepts - Groupe de Travail encadré par Rama Cont <i>Etude sur le risque de modèle dans les options multi sous-jacents. Etude de l'influence des corrélations entre sous jacents sur les prix d'options (modèles Black Scholes multivariés et modèles à sauts).</i> Prix du meilleur GT de finance - ENSAE 2005 Prix de l'Association Française de Gestion Actif Passif (AFGAP)/PRMIA 2006 |
| Juil. – Oct. 04 | BNP Paribas - CIB - ALM - Equipe Modèles Financiers - Stage <i>Stress testing sur le banking book clientèle euro.</i> <i>Mise en œuvre d'un outil de simulations et d'analyse de scénarios de taux/inflation.</i> <i>Econométrie sur encours de Dépôts à Vue pour évaluer un modèle comportemental.</i> |
| Avril – Sept. 03 | AXA France- Retraites Collectives - Service Ingénierie Financière - Stage <i>Optimisation intertemporelle de l'allocation de cotisations retraites suivant trois fonds (action, obligation et monétaire) pour un contrat de gestion par horizon.</i> |
| Juil. - Août 02 | Crédit Mutuel de Bretagne - Gestion des Risques - Stage <i>Choix d'une méthode de Value at Risk (étude et comparaison des méthodes historiques et analytiques), backtesting sur portefeuilles de négociation (VBA, progiciel Tradix et logiciel Riskmetrics).</i> |

INFORMATIQUE

| | |
|---------------|--|
| Logiciels | SAS, R, Maple, LaTeX, Business Objects, Bloomberg, Reuters |
| Programmation | C/C++, Java, VBA, Matlab, Caml |

LANGUES

| | |
|----------|---|
| Anglais | Lu, écrit, parlé, 590 points au TOEFL, 850 au TOEIC |
| Espagnol | Lu, écrit, parlé |

LOISIRS

| | |
|-------|---|
| Sport | Tennis, Sports de montagne (escalade, ski), course à pied (semi-marathon, marathon) |
| Cours | Cours particuliers de mathématiques (lycée) |