

## FORMATION

---

- 2000-04**      **Docteur en Sciences de Gestion (Finance) de Paris Dauphine**  
*Mention très Honorable avec Félicitations du Jury, Proposition pour Prix de Thèse et pour Publication*  
Doctorat effectué à l'ESSEC et Paris Dauphine sous la direction du Professeur Hélyette Geman : « Essais sur l'évaluation des actifs contingents sur actifs non négociés : de l'assurance à la finance »
- 2002-03**      **DEA de Probabilités et Applications, Filière Probabilités et Finance**  
Université de Paris VI - Pierre et Marie Curie, mention Assez Bien
- 1998-99**      **DEA de Finance de Marché et Gestion Bancaire** (Congé Individuel de Formation),  
Université de Paris I – Sorbonne, mention Bien
- 1991-94**      Diplômée de l'**Ecole Supérieure de Commerce de Reims (Reims Management School)**
- 1989**          Baccalauréat série C, **Option Internationale**, puis Classes Préparatoires HEC au lycée Henri IV

## EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

---

### Enseignement

---

- 2005**          **ESCP-EAP**  
Vacataire - chargée de cours sur « **Introduction à la finance** » (1<sup>ère</sup> année) : 60h (2 fois 30h)  
Cours sur les bases de mathématiques financières, sur les critères de choix d'investissement et sur l'analyse financière.
- REIMS MANAGEMENT SCHOOL**  
Vacataire - chargée de cours en :
- « **Analyse et Politique Financières** » (2ème et 3ème année) : 48h (2 fois 24h)  
Cours sur la politique financière et la stratégie, l'effet de levier et le risque financier, le coût du capital et la structure et la valeur d'une entreprise.
  - « **Gestion des Risques Atypiques** » (2ème et 3ème année) : 8h  
Cours sur la gestion et la couverture des risques sur dérivés d'énergie, dérivés climatiques et sur les catastrophes naturelles.
- 2003-05**      **CONSERVATOIRE NATIONAL DES ARTS ET METIERS, Chaire de Finance**  
ATER – chargée de TD et tutorat de l'enseignement à distance en :
- « **Finance d'entreprise : les outils** » et « **Finance d'entreprise : analyse financière** » : 100h
  - « **Gestion de portefeuille et des risques** » : 20h
  - « **Gestion financière à long terme et évaluation des actifs financiers** » : 70h

Il s'agit des tâches suivantes :

1. **Animation du site de l'enseignement à distance de la Chaire de Finance** (<http://idf.pleiad.net>) : mise en ligne des supports de cours et des exercices auto-administrés et participation au forum de discussion qui permet aux auditeurs d'exprimer leurs difficultés et d'obtenir des éclaircissements.
2. **Participation à l'élaboration des supports de cours** en collaboration avec les enseignants : rédaction de nouveaux supports et /ou enrichissement de documents existants.
3. **Elaboration des séries d'exercices auto-administrés.** Travail de construction d'exercices pour l'enseignement à distance et mise en place d'une auto-correction.
4. **Chargée des séances de regroupement et de Travaux Dirigés** : correction détaillée des exercices auto-administrés (séances de 3h). Les séances de regroupement sont bi-annuelles et les séances de TD sont bi-mensuelles.
5. **Permanence pour les auditeurs à distance** : réponses aux questions des auditeurs par téléphone ou par courrier électronique.

**2003**                    **CONSERVATOIRE NATIONAL DES ARTS ET METIERS, IIE**  
Vacataire chargée de cours de 2<sup>ème</sup> année sur « **L'évaluation des options en temps discret** » : 12h  
Cours sur la théorie de l'évaluation des options par arbres binomiaux et trinomiaux.

**2000-03**                **CONSERVATOIRE NATIONAL DES ARTS ET METIERS, Chaire de Finance**  
Chargée de TD et développement d'outils pédagogiques pour l'enseignement à distance en « **Finance d'entreprise** » et « **Marchés et produits financiers** » : 1.5 jours / semaine :  
Développement des exercices auto-administrés et élaboration des séances de regroupement

**ESSEC**

Assistante de cours sur les « **futures et options** » et sur « **l'évaluation des options exotiques** » : 20h  
Elaboration des séances de TD (durée 3h par séance)

---

**Expérience professionnelle**

---

**1999-00**                **CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ**  
*Responsable de la validation des modèles de pricing*, Service des Méthodologies - Risques de Marchés : validation des modèles de pricing et de valorisation, des systèmes de front et back

**1997-98**                *Responsable Risques de Marchés Actions*, Direction des Risques de Marchés  
*Management d'une équipe de 3 personnes* : méthodologie d'évaluation des risques et suivi

**1995-97**                *Responsable Risques de Contrepartie Actions*, Direction des Risques Actions

---

**Stages**

---

**2003-04**                **SOCIETE GENERALE ASSET MANAGEMENT**  
**Gestion Alternative – Produits Structurés**  
*18 mois dans l'équipe recherche : évaluation d'actifs en marchés incomplets, gestion de portefeuille, évaluation d'options sur inflation*

**1993-94**                **CREDIT LYONNAIS, Direction des Marchés Actions**  
*Assistante du Responsable Marché Primaire de Produits Dérivés sur Actions*  
*6 mois en front office*

**1993**                    **ICI FRANCE SA**  
*6 mois à la réalisation du budget 1994*

---

## LOGICIELS

---

Visual Basic, C++, C et bureautique.

---

## LANGUES

---

**ANGLAIS** **Bilingue.** Score au **TOEIC** : 950/990. Séjours réguliers en Angleterre et aux Etats-Unis.  
**ESPAGNOL** **Courant.** Certificat d'espagnol du **Baccalauréat International**, mention TB.  
**CHINOIS** **Notions.** Deux mois à l'Université de Shanghai.

---

## DOCUMENTS DE RECHERCHE

---

---

### Publications

---

« Alternative Approaches to Weather Derivatives Pricing », avec H. Geman, à paraître dans *Managerial Finance* 2005, Vol 31, n°6

---

### Communications à des congrès et séminaires

---

« Options on funds : bridging the gap between financial and actuarial pricing », présentations :

- à l'**AFFI** juin 2004 (Paris)
- au 31<sup>ème</sup> Annual Meeting of the **European Finance Association** août 2004 (Maastricht)
- au **Third World Congress Bachelier** juillet 2004 (Chicago)

« Prix et Stratégies d'Options sur Fonds », présentations

- aux Petits Déjeuners de la Finance (Maison des Polytechniciens) du 19/02/03
- au Séminaire du CEREG (Université de Paris Dauphine) du 13/10/03
- à la Journée de l'ESSEC (Maison des ESSEC) du 16/06/04

---

### Documents de travail

---

- « Evaluation des options barrières avec risque de saut »
- « Etude du smile de volatilité et arbres implicites »
- « Risque de défaut et évaluation de produits dérivés »