

Areski COUSIN

Maître de Conférences
ISFA, Université Lyon 1
50 av. Tony Garnier
69007 Lyon

✉ areski.cousin@univ-lyon1.fr

🌐 <http://www.acousin.net/>



Lyon, le 1^{er} mars 2012

Lettre de recommandation en faveur de Elena Di Bernardino

J'ai connu Elena au cours de ses trois années de thèse au sein du laboratoire de Sciences Actuarielle et Financière de l'ISFA.

Nous avons travaillé ensemble sur le comportement de certaines mesures de risque multivariées dans le contexte du calcul de capital réglementaire pour un ensemble d'institutions soumises à des risques inter-dépendants. Ce travail de recherche a fait l'objet du second chapitre de sa thèse et d'un article intitulé "A multivariate extension of Value-at-Risk and Conditional-Tail-Expectation" soumis au "Journal of Multivariate Analysis".

Elena m'a spontanément proposé de travailler sur ce sujet et c'est avec plaisir que j'ai accepté. Tout au long du projet, elle s'est montrée dynamique et efficace tant pour affronter les problèmes techniques liés à l'élaboration des résultats que pour la mise en forme de l'article. Par ailleurs, ses connaissances étendues en théorie du risque et notamment dans le domaine des ordres stochastiques et des fonctions copules, ont été d'une aide précieuse pour mener à bien ce projet. Les perspectives de recherche qui découlent de ce travail sont nombreuses.

De plus, j'ai beaucoup apprécié les échanges toujours très enrichissants que l'on a pu avoir pendant ses trois années de thèse et j'espère que l'on aura l'occasion de collaborer sur de nouveaux projets de recherche.

Enfin, je pense qu'Elena a les qualités d'un excellent enseignant-chercheur et je suis convaincu que l'institution qui la recrutera aura fait un excellent choix.

Areski COUSIN