

CURRICULUM VITÆ (Février 2012)

Renseignements personnels

Julien Guyon

Né le 3 mai 1977

Nationalité : Française

Actuellement : Quant, Global Markets Quantitative Research, Société Générale (Paris)

Adresse professionnelle :

Société Générale Corporate and Investment Banking
MARK/TRD/QRD
17 cours Valmy
92987 Paris La Défense cedex
France

Adresse personnelle :

24 rue des petites écuries
75010 Paris
France

Tel : +33 (0)1 42 13 97 09

Email : julien.guyon@m4x.org

<http://cermics.enpc.fr/~guyon/home.html>

Expérience professionnelle

- Depuis 2009 **“Quant” (analyste quantitatif) au sein de l’équipe Global Markets Quantitative Research de la Société Générale, Paris**
- Depuis 2011 **Professeur Associé Service Temporaire, Université Paris VII**
- 2006–2009 **“Quant” au sein de l’équipe Equity Derivatives Quantitative Research de la Société Générale, Paris**
- 2001–2002 **Crédit Lyonnais (aujourd’hui Calyon), Interest Rates Derivatives Quantitative Research (Paris) et Equity Derivatives Quantitative Research (Londres).**
Stage long. Etude théorique et numérique de modèles à volatilité stochastique.

Formation

- 2003–2006 • **Thèse de mathématiques appliquées (Probabilités et Statistique) au CERMICS (Ecole des ponts ParisTech, Paris)**
Directeur : Jean-François Delmas.
Mention très honorable avec félicitations du jury.
Thèse publiée par LAP Lambert Academic Publishing (ISBN : 9783838314464, 172 pages).
Prix de thèse 2006 de l’Ecole des ponts.
« *Modélisation probabiliste en finance et biologie. Théorèmes limites et applications* »
COMPOSITION DU JURY :
Jean-François Delmas Directeur (Ecole des ponts ParisTech)
Nicole El Karoui Présidente (Ecole polytechnique)
Bernard Lapeyre Examineur (Ecole des ponts ParisTech)
Sylvie Méléard Rapporteur (Université de Nanterre – Paris X)
Philip Protter Rapporteur (Cornell University)
Bernard Prum Examineur (Université d’Evry)
- 2002–2003 • **Master Probabilités et Applications, Université Paris VI.** Mention très bien.
- 2000–2003 • **Ecole des ponts ParisTech (Paris).** Corps des ponts et chaussées. [Probabilités, Mathématiques financières, Informatique, Mécanique]
- Printemps 2000 • **Ecole normale supérieure (Paris), Département d’Informatique.** Projet de recherche encadré par François Baccelli, probabilités appliquées au calcul de débits Internet. [Chaînes de Markov]
- 1997–2000 • **Ecole polytechnique (Paris),** Rang de sortie : 55/400. [Mathématiques, Physique, Economie]

Activités d'enseignement actuelles

Université Paris VII : Professeur Associé Service Temporaire

Instruments Financiers et Modèles, Professeur, depuis 2011, Master2 M2MO (Modélisation aléatoire), 48h/an, 50 étudiants.

Ecole des ponts ParisTech (Paris)

Mathématiques Financières, Professeur, depuis 2008, 21h/an, 70 étudiants.

Activités d'enseignement passées

Ecole des ponts ParisTech (Paris)

Probabilités et Statistique, Professeur, 2004–2006.

Statistique et Analyse de Données, Professeur, 2005–2006.

Mathématiques Financières, Chargé de TD, 2004–2006.

Ecole nationale supérieure de techniques avancées (Paris)

Introduction aux Probabilités et Statistiques, Chargé de TD, 2003–2006.

Lycées Louis-Le-Grand and Henri IV (Paris)

Colles de mathématiques, Classes Préparatoires aux Grandes Ecoles, 1998–2004.

Livres

- [1] 2012 **Guyon, J. et Henry-Labordère, P.** *Numerical methods for non-linear problems in quantitative finance*. En préparation.
- [2] 2009 **Guyon, J.** *Probabilistic modeling in Finance and Biology. Limit Theorems and Applications*. LAP Lambert Academic Publishing, 2009 (ISBN : 9783838314464, 172 pages). Manuscript de thèse.
- [3] 1998 **Guyon J.** *Les clés du problème*. Ellipses, Paris, 1998 (ISBN : 2-7298-6836-4, 218 pages). Livre de préparation aux épreuves de mathématiques des concours d'entrée aux Grandes Ecoles pour les élèves de Mathématiques spéciales.

Publications dans des revues à comité de lecture

- [1] 2012 **Bergomi, L. et Guyon, J.** *The smile in stochastic volatility models*. A paraître dans Risk Magazine.
- [2] 2012 **Guyon, J. et Henry-Labordère, P.** *Being particular at calibration*. Risk Magazine, janvier.
- [3] 2011 **Guyon, J. et Henry-Labordère, P.** *From spot volatilities to implied volatilities*. Risk Magazine, juin.
- [4] 2011 **Guyon, J. et Henry-Labordère, P.** *Uncertain volatility model : a Monte-Carlo approach*. Journal of Computational Finance 14(3).
- [5] 2007 **Guyon, J.** *Limit theorems for bifurcating Markov chains. Application to the detection of cellular aging*. Annals of Applied Probability, 24(5,6), 1538–1569.
- [6] 2006 **Guyon, J.** *Euler scheme and tempered distributions*. Stochastic Processes and Their Applications 13(6), 877–904.

Publications dans des proceedings avec comité de lecture

- [1] 2005 **Guyon, J., Bize, A., Paul, G., Stewart, E., Delmas, J.-F. et Taddéi F.** *Statistical Study of Cellular Aging*. ESAIM Proceedings, CEMRACS 2004 - Math. and appl. to Biology and Medicine, 55, 100–114.

Chapitre de polycopié de cours

- [1] 2003 **Guyon, J.** *Rédaction du chapitre “Volatilité stochastique” pour les notes du cours “Modèles Stochastiques en Finance” de Nicole El Karoui* Master de Probabilités et Finance, Université Paris VI.
Disponible à l’adresse <http://www.cmap.polytechnique.fr/~elkaroui/masterfin034.pdf>.

Article de vulgarisation

- [1] 2011 **Guyon, J.** *Le smile dans les modèles à volatilité stochastique*. Les cahiers de l’Institut Louis Bachelier, n°3, Numéro spécial : mieux comprendre la recherche en finance, juillet 2011.

Participation à des conférences, congrès, colloques, workshops en tant qu’orateur invité

- 2012 • **Global Derivatives Trading and Risk Management 2012** *Barcelone* (avril)
 • **Conference on Quantitative and Statistical Finance** *Université Paris VII* (mars)
- 2011 • **Research In Options 2011 Conference (RIO2011)** *IMPA, Rio de Janeiro* (novembre)
 • **Global Derivatives Trading and Risk Management 2011** *Paris* (avril)
 • **Modelling and Managing Financial Risks** *Conférence internationale organisée à Paris dans le cadre de la chaire “Risques Financiers” (Ecole polytechnique - Ecole des ponts - Société Générale) de la Fondation du Risque* (janvier)
- 2010 • **Research In Options 2010 Conference (RIO2010)** *IMPA, Rio de Janeiro* (novembre)
- 2009 • **Research In Options 2009 Conference (RIO2009)** *IMPA, Rio de Janeiro* (novembre)
- 2008 • **“Journées MAS” da la SMAI** *Université de Rennes 1* (août)
- 2006 • **Workshop on Mathematical Finance** *Kyoto University* (août)
 • **31st Conference on Stochastic Processes and their Applications (SPA2006)** *Université Paris V* (juillet)
 • **Journées de Statistique** *EDF, Paris* (mai)
 • **Amamef International Conference on Numerical Methods in Finance** *INRIA Rocquencourt* (février)
 • **VIIth Workshop on Quantitative Finance** *Università degli Studi, Perugia* (janvier)
- 2005 • **Quantitative Methods in Finance Conference (QMF2005)** *University of Technology, Sydney* (décembre)
 • **Journées de probabilités, septembre 2005.** *Institut Elie Cartan, Nancy* (septembre)

Exposés à des séminaires ou des groupes de travail

- 2011 • **“Finance mathématique, probabilités numériques et statistique des processus”** *Université Paris VII* (octobre)
 • **“MathFi”** *Université de Marne-la-Vallée* (mai)
- 2010 • **“MathFi”** *Université de Marne-la-Vallée* (janvier)
- 2009 • **MASEF** *Université Paris-Dauphine* (novembre)
 • **de la chaire ““Risques Financiers” (Ecole polytechnique - Ecole des ponts - Société Générale) de la Fondation du Risque** *Palais Brogniart, Paris* (septembre)
 • **“Systèmes complexes”** *Ecole des ponts ParisTech, Paris* (septembre)
- 2008 • **“Calcul stochastique et finance”** *Ecole polytechnique, Paris* (April)

- 2005
 - **HSBC Capital Markets Research** *Paris* (novembre)
 - **“Probabilités, statistique et biologie”** *Université Paris V* (octobre)
 - **OMEGA** *INRIA Sophia-Antipolis* (septembre)
 - **Bachelier, juin 2005.** *Institut Henri Poincaré* (juin)
 - **“Probabilités numériques, statistique des processus et finance”** *Université Paris VI* (avril)
 - **“MathFi”** *Université de Marne-la-Vallée* (février)
- 2002
 - **“MathFi”** *INRIA Rocquencourt* (novembre)

Activités d’animation et administratives

- **Membre de la chaire “Risques Financiers”** (Ecole polytechnique - Ecole des ponts - Société Générale) de la Fondation du Risque
- **Membre du comité local d’organisation de la conférence “Modelling and managing financial risks”** Conférence internationale organisée à Paris dans le cadre de la chaire “Risques Financiers” (Ecole polytechnique - Ecole des ponts - Société Générale) de la Fondation du Risque (Paris, janvier 2011)
- **Représentant des élèves de l’Ecole des ponts ParisTech au Conseil d’Enseignement et de Recherche** (2001)
- **Représentant des élèves de l’Ecole polytechnique au Département de mathématiques** (1999)

Referee activity

- Mathematical Finance
- Journal of Statistical Planning and Inference
- Journal of Computational Finance
- Risk Magazine

Other experience

- | | |
|--------------|--|
| Automne 2000 | Direction départementale de l’équipement du Val d’Oise, service de l’assainissement et des réseaux Conseil en télégestion des bassins de retenue. |
| Été 1999 | Projet humanitaire (Bolivie) Création d’un réseau d’eau potable au sein d’une communauté quechua de l’Altiplano. |
| 1997–1998 | Service national. Lieutenant. Surveillance et cours de soutien dans un lycée professionnel de la banlieue de Strasbourg. |

Langues

Français langue maternelle, **Anglais** courant, **Espagnol** courant, **Italien** lu.

Informatique

Environnements : Unix, Windows

Programmation : C, C++, VBA, Java, Matlab, Scilab