

HENRI JACOB



GESTION DES RISQUES ET BÂLE III – ALM – MARCHÉS FINANCIERS

EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

2001 à ce jour

- Afges – Formation Banque-Finance - Animateur - Formations (en français ou anglais) dans les établissements de crédit sur
 - Bâle III.
 - Basel III (en anglais).
 - Finalisation de Bâle III.
 - Bâle III Pilier 2 SREP RAF Stress tests ICAAP ILAAP.
 - Own funds (en anglais).
 - Ratios prudentiels et les règles de gestion.
 - Ratio de résolution MREL.
 - Risque de crédit.
 - Credit risk (en anglais).
 - Audit du risque de crédit.
 - L'approche IRB.
 - Modélisation du risque de crédit et stress tests.
 - Évaluation des prêts à la valeur de marché.
 - Mesure et gestion du risque de contrepartie et les différents ajustements de valeur XVA.
 - CVA.
 - Mesure et gestion des risques de marché.
 - Mesure et gestion des risques bancaires.
 - Gestion actif-passif (ALM).
 - ALM (en anglais).
 - Risque de liquidité.
 - IRRBB.
 - **Environnement – acteurs et fonctionnement des marchés financiers.**
 - Initiation aux produits dérivés.
 - Pricing des produits dérivés.
 - Dérivés de crédit.
 - Évaluation des produits de taux.
 - Mesure et gestion du risque de liquidité.
 - Mesure et gestion de l'IRRBB.
 - Réglementation bancaire sur les règles prudentielles.
 - CRR2.

- Basel III and its finalization (en anglais).
- Fonds propres Bâle III et ratio de levier.
- Options exotiques : risques, modèles, évaluation et couverture.
- Dispositif de résolution (BRRD1, BRRD2, CRR2) et ratios TLAC/MREL.
- L'analyse des stress tests réalisés sur les principaux risques bancaires.

1994 à 2001

- Optigestion - Directeur de recherche
 - Économiste et travaux sur les marchés financiers internationaux.

1988

- Cecogest
 - Bureau d'étude macroéconomique et société de gestion de portefeuilles institutionnels, notamment de fonds de pension américains.
 - Économiste, travaux sur les marchés financiers internationaux, notamment mise au point « d'indicateurs de prévision ».

1985

- Banque Lazard - Analyste financier
 - Secteur des « Fusions-Acquisitions ».

FORMATION

- Doctorat de 3ème cycle de Mathématiques.
- D.E.A. d'Économie Monétaire.
- Licence d'histoire.

PUBLICATIONS

- « Bâle III et sa finalisation », éditions AFGES, 2020.
- « Management des risques bancaires », deuxième édition, éditions AFGES, 2020.
- Article: « Kernels in graphs with a clique-cutset ».
- Article avec H. Meyniel : « About quasi-kernels ».

LANGUES

- Français.
- Anglais.