

Biographical note: Peter Christoffersen

Peter Christoffersen is currently a Professor of Finance at the University of Toronto's Rotman School of Management. Prior to that, he was an Associate Professor of Finance at McGill University's Desautels Faculty of Management from 1998 to 2010, and an economist at the International Monetary Fund from 1996 to 1998. Since 2012, he has also been a member of the Model Validation Council at the Board of Governors of the U.S. Federal Reserve System.

Professor Christoffersen is recognized internationally as an expert in risk management. He has delivered workshops and technical training seminars on the subject at a number of public and private institutions that include the Bank of Canada, the European Central Bank and the World Bank. He has published widely in the areas of risk management, volatility modelling and financial engineering, particularly options pricing. His current research focuses on developing a deeper understanding of the dynamics of financial market volatility and their relationship to the real economy, enhancing fundamentals-based stress-testing techniques, and exploring changing cross-country financial linkages.

Professor Christoffersen is a research fellow at CIRANO, the Copenhagen Business School and Aarhus University's Center for Research in Econometric Analysis of Time Series (CREATES), as well as at a number of other organizations such as the Volatility Institute at New York University's Stern School of Business and the Wharton Financial Institutions Center at the University of Pennsylvania. He is Associate Editor at the *Journal of Risk*, the *Journal of Financial Econometrics*, the *Journal of Applied Econometrics* and the *Review of Financial Studies*. He has been a Visiting Scholar at, among others, the European Central Bank and the Board of Governors of the Federal Reserve System in the United States.

Professor Christoffersen is a native of Denmark and holds a BA in economics from the University of Copenhagen (1990) and a PhD in economics from the University of Pennsylvania (1996).

Notice biographique : Peter Christoffersen

Peter Christoffersen est professeur de finance à la Rotman School of Management de l'Université de Toronto. Auparavant, il a été professeur agrégé de finance à la Faculté de gestion Desautels de l'Université McGill de 1998 à 2010, après avoir occupé un poste d'économiste au Fonds monétaire international de 1996 à 1998. Depuis 2012, il est également membre du Model Validation Council du Conseil des gouverneurs de la Réserve fédérale américaine.

M. Christoffersen est reconnu à l'échelle internationale en tant qu'expert en gestion des risques et, à ce titre, a présenté des ateliers et des séminaires de formation technique sur le sujet organisés par de nombreuses institutions des secteurs public et privé, dont la Banque du Canada, la Banque centrale européenne et la Banque mondiale. Il a publié abondamment dans les domaines de la gestion des risques, de la modélisation de la volatilité et de l'ingénierie financière, plus particulièrement l'évaluation des options. Ses recherches actuelles visent à mieux comprendre la dynamique de la volatilité des marchés financiers et ses liens avec l'économie réelle, à améliorer les techniques de tests de résistance fondées sur les bases économiques et à explorer la nature évolutive des liens financiers entre les pays.

M. Christoffersen est chercheur auprès du Centre interuniversitaire de recherche en analyse des organisations (CIRANO), de l'École de commerce de Copenhague et du Center for Research in Econometric Analysis of Time Series (CREATES) de l'Université d'Aarhus, ainsi que dans plusieurs autres organisations, dont le Volatility Institute de la Stern School of Business de l'Université de New York et le Wharton Financial Institutions Center de l'Université de la Pennsylvanie. Il est membre du comité de rédaction du *Journal of Risk*, du *Journal of Financial Econometrics*, du *Journal of Applied Econometrics* et de la *Review of Financial Studies*. Il a aussi travaillé à titre de chercheur invité à la Banque centrale européenne et au Conseil des gouverneurs de la Réserve fédérale des États-Unis, notamment.

Originaire du Danemark, M. Christoffersen est titulaire d'un baccalauréat en économie de l'Université de Copenhague (1990) et d'un doctorat en économie de l'Université de la Pennsylvanie (1996).