



EL YOUSEFI AHMED

Quantitative Analyste

+212 778278749

elyousefi.ahmed@outlook.com



AMD-hub



Ahmed EL YOUSEFI



Rabat, Maroc



01 oct 2001

À PROPOS

Diplômé en finance quantitative, spécialisé en modélisation statistique et méthodes de pricing, risque management et stratégies de trading, je cherche une première opportunité en finance de marché pour contribuer à des projets innovants avec motivation, adaptabilité et esprit d'équipe.

FORMATION

Institut National de Statistique et d'Économie Appliquée

Rabat, Maroc

Ingénieur en Actuariat et Finance Quantitative Octobre 2021 - Juillet 2024

- **Cours Pertinents** : Économétrie, Calcul Stochastique, Méthodes Quantitatives, Théorie des Risques, Méthodes Statistiques en Finance, Produits à Revenu Fixe, et Marchés Financiers.
- **Sujets Pertinents** : Optimisation, Modélisation Linéaire, Non-linéaire, et Séries Temporelles.

Classes Préparatoires aux Grandes Écoles

Salé, Maroc

Mathématiques et Physique Septembre 2019 - Juillet 2021

- **Cours Pertinents** : Mathématiques et Programmation en Python.

EXPÉRIENCE

La Marocaine Vie

Casablanca, Maroc

Stagiaire Actuaire Février 2024 - Juillet 2024

- Mise en œuvre de la norme IFRS 17 sur les contrats de cession pour le produit d'assurance vie (décès emprunteur).
- Création du compte de résultat et analyse P&L (identification des leviers de pilotage).

Financial Risk Solution

Casablanca, Maroc

Stagiaire risk manager Juillet 2023 - Août 2023

- Développement d'un pricer obligataire, valorisation d'un portefeuille et estimation de la Value-at-Risk en appliquant les approches historique, paramétrique et par simulation Monte Carlo.
- Calibration du modèle HJM sur les taux instantanés à terme à partir des données du Trésor américain (2000-2015).

PROJETS

Back-Testing des stratégies de trading Novembre 2024

- Développement et implémentation de stratégies de trading quantitatives.
- Utilisation de la bibliothèque Python Backtrader pour tester ces stratégies sur des données financières historiques et évaluer leurs performances.

Bibliothèque Python pour la Simulation Stochastique et l'Inférence Statistique Juillet 2024

- Développer une structure de données adaptée aux séries temporelles.
- Définir une classe de processus de diffusion. Avec des méthodes de simulation d'Euler et d'estimation par EMV.

Valorisation des options asiatiques Avril 2024

- Estimation par Maximum de Vraisemblance du modèle B&S pour les données S&P 500 de 2010 à 2020.
- Valorisation des options asiatiques basée sur la Simulation Monte Carlo et l'EDP de Rogers-Shi.

COMPÉTENCES

Langues

Arabe : Fluent

Français : Avancé

Anglais : Intermédiaire

Compétences Techniques

- **Langages de Programmation** : Python, R, VBA EXCEL, SAS, C++, SQL
- **Ingénierie Financière** : Gestion des Risques, Tarification des Produits Dérivés, Produits de Taux Fixe et modélisation de la Courbe des Taux, Optimisation de Portefeuille
- **Analyse Statistique** : Analyse de Régression, Prévisions de Séries Temporelles (ARIMA, SARIMA...), Tests Statistiques.

Compétences Interpersonnelles

Pensée Analytique, Résolution de Problèmes, Communication, Travail en Équipe.