

## **Assistant Arbitrage statistique**

**Amundi**

**REFERENCE** : 8371/DBEN/...

**POUR POSTULER** : <http://ca.contactrh.com/jobs/1536/4508699>

**TYPE DE CONTRAT** : Stage

**LOCALISATION** : Paris 15 75015, France

**NIVEAU D'ETUDES** : Bac +4

**ANNEES D'EXPERIENCE** : < 6 mois

**DATES** : À partir du 15/07/2013

**DUREE** : 6 mois

**SECTEUR** : Banque/Assurance/Finance (Banque/Etablissement financier/Crédit Bail...)

**FONCTION** : Systèmes d'informations / télécom (Analyste Programmeur)

**SOCIETE :**

Amundi est issue du rapprochement des expertises de gestion d'actifs du Crédit Agricole SA (75%) et de la Société Générale (25%), concrétisant ainsi une vision commune de la gestion d'actifs qui répond aux nouveaux défis de l'industrie pour servir plus efficacement ses clients.

Avec près de 750 milliards d'euros sous gestion, ses trois mille collaborateurs, Amundi compte parmi les dix premiers acteurs mondiaux de l'Asset Management et dispose de centres de gestion couvrant les principales places financières en Europe et dans le monde.

**DESCRIPTION DU POSTE :**

La gestion Performance Absolue consiste à générer de la performance quelque soit la direction des marchés. Pour ce faire, le desk arbitrage utilise des stratégies d'arbitrage L/S sur les actions et futures.

Vous nous assisterez dans la recherche de modèles d'arbitrage basés sur des indicateurs de prix des actifs (volatilité, corrélation, beta, dispersion...) dont la fréquence des données ira de moyenne (journalière) à hautes (Intraday).

Votre mission consiste à :

- \* Modéliser les algorithmes de sélection des actifs à partir d'indicateurs statistiques,
- \* Améliorer les outils de simulation des stratégies pour vérifier leur pertinence historique,
- \* Implémenter différentes construction de portefeuille dont le but sera de gérer les risques inhérents aux modèles d'arbitrage

**PROFIL :**

Formation : Master I ou II

Spécialisation : Mathématique / Statistique / Informatique

Langues : Anglais courant

Qualités recherchées : Connaissance de la finance sera un plus, Anglais courant, Curiosité, Autonomie, Rigueur, Organisation

**POUR POSTULER :** <http://ca.contactrh.com/jobs/1536/4508699>