

# DOSSIER DE COMPETENCES

<Statut> Junior Consultant Engineer

<Offre de compétences> Analyse, recherche de solution et automatisation de tâches logiques

## Domaines de compétences

---

- ◆ Finance de marché
- ◆ Informatique
- ◆ Mathématiques appliquées

## Environnements d'interventions

---

- ◆ BFI, Assurance
- ◆ PME

## Environnements techniques

---

- ◆ VBA
- ◆ SQL
- ◆ C/C++
- ◆ MATLAB
- ◆ R
- ◆ SAS
- ◆ Système d'exploitation : Windows, Unix, Bureautique : MS-Office, Latex

# Expériences

## <NATIXIS ASSET MANAGEMENT / ALTRAN TECHNOLOGIE>

<1 Ans 10 Mois>

**Domaine de compétences :** Finance et Informatique (Analyse, traitement de données, automatisation)

**Intitulé de l'intervention :** Développeur de proximité des équipes risques (marché, contraintes et opérations, opérationnel, conformité)

### | Objectifs :

- ◆ Suivre et assurer le bon fonctionnement des développements de proximité des équipes contrôle permanent et risque marché
- ◆ Améliorer les outils existants
- ◆ Développer de nouveaux outils
- ◆ Extraire des données pour les équipes
- ◆ Administrer le serveur (SQL server 2008) de production quotidien

### | Réalisations :

- ◆ Migration des outils existant d'office 2003 à office 2010
- ◆ Suivi journalier de la production de données
- ◆ Mise en place d'un contrôle du cash
- ◆ Mise en place d'un suivi de l'emprise sur des fonds internes et externes
- ◆ Mise en place d'un contrôle du niveau de leviers des fonds
- ◆ Amélioration du suivi des franchissements de seuil et mise à jour de la documentation
- ◆ Unification des calculs de statistique sur les dépassements constatés par les équipes risques
- ◆ Mise en place d'un outil d'agrégation des données pour alimenter les rapports annuels des fonds
- ◆ Travaux de sécurisation des traitements d'alimentation de l'outil de suivi des contraintes
- ◆ Amélioration du contrôle des opérations entre portefeuille
- ◆ Mise en place d'un outil pour identifier les positions sur certains titres suivant différents critères (Secteur, place de négociation, place d'enregistrement de titres, type d'actif, ...)
- ◆ Mise en place d'un suivi du swing prancing
- ◆ Demandes ponctuelles d'extraction de données
- ◆ Harmonisation de code et réécriture, correction de bugs divers

### | Environnements techniques :

- ◆ WINDOWS, MICROSOFT OFFICE, VBA, SQL, SQL SERVER 2008

## <SG CIB / SALOME INFORMATIQUE>

---

<3 Mois>

**Domaine de compétences :** Finance, Programmation

**Intitulé de l'intervention :** Commando VBA

### | Objectifs :

- ◆ Comprendre le besoin du client, l'affiner
- ◆ Proposer une solution algorithmique
- ◆ Développer une macro avec les librairies adéquates
- ◆ Conduire les tests
- ◆ Participer au support des solutions existantes

### | Réalisations :

- ◆ Développement de nouvelles macros
- ◆ Amélioration des macros existantes
- ◆ Création de script d'automatisation
- ◆ Mise en place de nouvelles bases de données
- ◆ Simplification de certaines procédures

### | Environnements techniques :

- ◆ WINDOWS/VBA/SQL, ELIOT, BCS, EFTS, ALISE, SOCRATE

## <Crédit Mutuel Arkéa >

---

<6 Mois>

**Domaine de compétences :** Finance de Marché, Programmation, Algorithmique

**Intitulé de l'intervention :** Mise en œuvre du suivi des valorisations des activités de Marché et mise en place d'une librairie de calculs financiers sous VBA

### | Objectifs :

- ◆ Contrôle de l'activité de marché
- ◆ Suivi des valorisations des produits financiers dans le portefeuille CM Arkéa
- ◆ Mise en place d'une librairie financière complète
- ◆ Calcul automatique de la CVA et de l'Initial Margin
- ◆ Production de documents techniques

### | Réalisations :

- ◆ Contrôle quotidien des données de marché
- ◆ Suivi quotidien des indicateurs de risque et de performance
- ◆ Contrôle des méthodes de valorisation dans Murex
- ◆ Automatisation du reporting journalier
- ◆ création d'une librairie financière, construction des courbes de taux par les méthodes Mono courbe et Bi courbes, Stripping de la volatilité
- ◆ Mise en œuvre des indicateurs CVA et de l'Initial Margin (EMIR)
- ◆ Intégration de la CVA dans la grille de valorisation du Front Office
- ◆ Rédaction de procédures et de documents de référence

### | Environnements techniques :

- ◆ WINDOWS / VBA, EXCEL, BO, MUREX, BLOOMBERG, REUTEURS, NUMERIX

## <Laboratoire J.A. Dieudonné >

---

<6 Mois >

**Domaine de compétences :** Finance, Mathématiques appliquées, Programmation, Algorithmique

**Intitulé de l'intervention :** Analyste Quantitatif

| **Objectifs :**

- ◆ Etude des modèles de volatilité
- ◆ Rédaction d'un rapport
- ◆ Concilier les différents modèles de valorisation à volatilité constante et stochastique
- ◆ Etude du modèle de Black and Scholes
- ◆ Etude du modèle de Heston
- ◆ Etude du modèle de Bates
- ◆ Etude des modèles à sauts
- ◆ Simulations numériques, tests, comparaison de différents algorithmes et analyse des résultats
- ◆ Généralisation
- ◆ Rédaction d'un mémoire

| **Réalisations :**

- ◆ Algorithmes
- ◆ Programmes
- ◆ Mémoire

| **Environnements techniques :**

- ◆ WINDOWS/ R, C++/Bloomberg

## Formations

- ♦ **2013–14** IGR–IAE Rennes, Gestion Des Risques, Master 2
- ♦ **2013** IGR–IAE Rennes, Certification de l'Autorité des Marchés Financiers (AMF)
- ♦ **2012** Univ. Sophia–Antipolis Nice, Ingénierie mathématique et méthodes quantitatives appliquées à l'Economie, la Finance et l'Actuariat, Master 2

## Langues étrangères

- ♦ **Anglais** Niveau : Opérationnel