

# DOSSIER DE COMPETENCES

<Statut> Consultant Engineer

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

## 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 AM / INDEPENDANT – ALTRAN TECHNOLOGIE >

---

<3 A>

**Domaine de compétences :** Analyse, traitement de donnée, automatisation (finance et Programmation)

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

### | Objectifs globaux :

- ◆ Comprendre le besoin du client, l'affiner
- ◆ Proposer une solution
- ◆ Programmer la solution choisie par le client
- ◆ Conduire les tests
- ◆ Mise en place d'évolution
- ◆ Correction de bug

### | Réalisations :

- ◆ Mise en place de nouvelles applications
- ◆ Amélioration des outils existants
- ◆ Création de scripts d'automatisation
- ◆ Simplification des procédures existantes
- ◆ Création de reportings automatisés

### | Environnements techniques :

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

## <SG CIB / SALOME INFORMATIQUE>

---

<3 M>

**Domaine de compétences :** Programmation, Algorithmique

**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 :

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

## <Crédit Mutuel Arkéa >

---

<6 M>

**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 :**

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

## <Laboratoire J.A. Dieudonné >

<6 M >

**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 :**

- ◆ , C++, R, Bloomberg, WINDOWS



## 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