# 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