



Duc Hien VU

Né le 25 Juillet 1991
Nationalités : française, vietnamienne
Adresse: 51 rue de Tolbiac
75013 Paris, France

Contactez-moi :

- (+33) 6 16 85 66 06
- duc.hien.vu.91@gmail.com
- <http://littleactuary.github.io/>
- <https://linkedin.com/in/duc-hien-vu-50b20627>

Expériences professionnelles



Varathon – Fondateur (Janvier 2020 – Présent)

- Varathon est une micro-entreprise qui développe des applications web pour l'Actuariat et la Finance (gestion des risques, modélisation ALM, gestion de portefeuille ...)
- Retrouvez-nous sur <https://varathon.fr>



Covéa – Responsable d'études statistiques & actuarielles

Etude & Allocation d'Actifs – Direction des Placements & Actif/Passif (Mai 2020- Présent)

- ORSA (prospectif & permanent), Allocation stratégique d'actif, PRIIPS, Stress Tests
- Mesure de la rentabilité des produits d'assurance structurés (supports à promesse)
- Recherche sur le générateur de scénarios économiques (risque-neutre & monde réel)
- Etudes des problématiques autour de la politique de résultats & stratégie d'investissement

Suivi Règlementaire Domaine Vie – Direction des placements & Actif/Passif (Janvier 2018- Avril 2020)

- Production Solvabilité II – Pilier I (calculs trimestriels & annuels), VA C2C
- Définition de la méthodologie, des process & développement des maquettes d'automatisation des calages actifs, passifs, de contrôles, d'analyses des résultats S2, de génération et validation des QRT
- Interlocuteur de la MOA & la MOE pour les projets *fast-close* et d'industrialisation, interlocuteur du fournisseur de logiciel de modélisation pour les recettes, l'intégration et l'amélioration de l'outil
- Etudes techniques pour répondre aux reco. ACPR et aux besoins du groupe (Analyse de FP S2, marges futures, BE, SCR, ratio S2, étude d'impact de la fusion des cantons, de la politique de taux servis, modélisation du taux concurrentiel et de la loi de rachats conjoncturels, etc.)



EY – Senior Consultant en Actuariat (Décembre 2015 – Décembre 2017)

- Missions de conseil & d'audit pour les compagnies d'assurance (Covéa, Générali, SCOR, MME, etc.) sur les problématiques de Solvabilité II, MVBS, IFRS, modélisation ALM, etc.
- Développement des outils de modélisation/d'analyse ALM, back-testing
- Etudes diverses (benchmark modèles S2 européens, politiques de PB, etc.)
- Participation à l'élaboration des réponses aux appels d'offre et aux réunions avec les clients



AXA – Chargé d'études actuarielles au sein des différentes entités AXA (Juin 2014 – Mai 2015)

AXA Corporate Solutions (stage à temps plein – 6 mois)

- Mise en place d'une méthode de provisionnement pour les sinistres graves (seuil grave déterminé par la théorie des valeurs extrêmes, IBNeR (méthode individuelle) et IBNyR (approche coût-fréquence))
- Développement d'un outil correspondant avec R, Shiny et Google Chrome (version portable)
- Détermination des clés d'allocation de la charge de sinistres issue du modèle par succursale

AXA Global P&C (stage à temps partiel – 6 mois)

- Amélioration et accélération de l'outil de modélisation CAT/Atypique et de tarification (R/C++)
- Ajout des nouvelles fonctionnalités, restructuration, intégration du programme à la plateforme web
- Mesure des impacts d'un changement de structure de réassurance

AXA Solutions Collectives (stage à temps plein – 4 mois)

- Etude et nettoyage des distributions de sinistres dentaires (SAS)
- Création d'un outil de mesure d'impact tarifaire du plafond dentaire (EXCEL/VBA)
- Etude de consommation en santé des assurés seniors avant le passage à la retraite



Université Paris-Dauphine – Moniteur chez CRIO-Multimédia (Mars 2013 – Mai 2014)

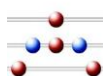
- Développement Excel/VBA, Mise à jour des logiciels dans les salles informatiques CRIO
- Maintenance des ordinateurs et des imprimantes

Activités/Associations



Institut des Actuaire (2016 – Présent)

Membre associé



Diffusion Internationale de l'Actuariat Francophone (D.I.A.F.) (2016 – Présent)

Membre & WebMaster



LittleActuary - <http://littleactuary.github.io/> (2015 – Présent)

Blog personnel pour partager les connaissances/expériences en Actuariat, Finance & Informatique

En 2020 : lancement d'un cours en ligne pour la préparation des examens SOA

Formation



Institut des Actuaire (2016)

Actuaire associé – Mémoire sur le provisionnement des sinistres graves chez AXA CS



ENSAE Paris (2012 - 2015)

Diplôme d'Ingénieur, Master (parcours Actuariat)

Intégration en 2^e année directe (2013) après un Master 1 Maths appliquées à l'université Paris - Dauphine



Université Paris-Dauphine (2009 – 2012)

Double licence Mathématiques appliquées – Economie appliquée

Intégration en 2^e année (2010) de Licence Maths/Info après une première année de Licence à l'UPEC

Compétences informatiques et linguistiques

Informatique	Logiciels : Prophet, Solvéo, Bloomberg, RiskIntegrity, EVIEWS, Stata, etc.
	Programmation : R, Python, SQL, VBA, SAS, Java, C/C++, Matlab/Scilab, ADA
	Développement Web : Python (Flask), Javascript (jQuery, React), HTML, CSS (Bootstrap), etc.
Langues	Vietnamien (langue maternelle), Français (bilingue), Anglais (bilingue), Chinois (élémentaire)

Centres d'intérêt

Musique (Guitare *fingerstyle* & composition de musique), Course à pied (toutes distances de 10km à Marathon), Finance (Bourse, Finance de marché & Finance d'entreprise), Informatique (I.A. & les technologies Web)