



Samer Said

24 ans
Elève ingénieur

✉ 34 rue Victor Basch 91300
Massy, France

☎ 06 11 19 82 08

@ samer.said@polytechnique.edu

Langues

- Arabe : Maternelle
- Français : Bilingue
- Anglais : Avancé [TOEIC 910/990]

Software

- R
- C/C++
- Python
- Matlab
- Microsoft Excel
- Visual Basic pour Applications (VBA)

Connaissances

- Apprentissage statistique
- Calcul stochastique
- Processus de Lévy
- Méthodes de Monte-Carlo
- Chaînes de Markov
- Optimisation différentiable
- Gestion de portefeuille
- Trading algorithmique
- GARCH and stochastic volatility models
- Valorisation et couverture de produits dérivés
- Options, futures et autres actifs dérivés
- Gestion et mesure des risques
- Risque de crédit
- Machine learning pour la finance

Intérêts et Activités

- Membre senior dans le club MINDS|TA (2016-2018)
- Membre actif dans l'association tunisienne d'échange culturel ATACJL
- Voyager, Jouer et regarder le football

Formation

- 2018-2019 Master M2 ENSAE
 • M2 Statistique & Finance à l'ENSAE (Ecole nationale de la statistique et de l'administration économique).
- 2016-2019 Diplôme ingénieur : 3ème année ENIT - ENSTA ParisTech
 • Formation dans un accord entre ENSTA ParisTech (Ecole nationale supérieure des techniques avancées) et ENIT (Ecole nationale d'ingénieurs de Tunis). Parcours : Finance quantitative.
- 2014-2016 Cycle préparatoire Mathématiques-Physique IPEIT
 • Diplôme de fin du cycle préparatoire de l'institut préparatoire aux études d'ingénieurs de Tunis, rang : 18/2200.
- 2010-2014 École secondaire Lycée pilote de sousse
 • Diplôme du baccalauréat mathématiques - Mention très bien.

Expériences

- juin 2019 Stage fin d'études (6 mois) Analyste quantitatif chez CA-CIB/Équipe MQP
 • Amélioration des modèles existants pour le pricing d'actifs maritimes basés sur des statistiques avancées et des techniques de machine learning.
 • Développement de la librairie des modèles existante en R (Automatisation des calculs réalisés...).
- Mai 2018 Stage de recherche (3 mois) Institut Louis Bachelier
 • Développer en R des modèles économétriques pour modéliser l'erreur de prévision de la consommation nette de l'électricité en France métropolitaine afin d'estimer finalement le coût de la volatilité de la production intermittente sur les marchés day-ahead de l'électricité.
- Juillet 2017 Stage ouvrier (1 mois) LEONI wiring systems-Tunisie
 • Département du service méthode et qualité.
 Projet réalisé : Suivi d'une chaîne de production (relever les gaspillages, optimiser l'ergonomie de la chaîne, améliorer l'efficacité).

Projets académiques

- 2019 Valorisation d'une option Américaine (3 mois) ENSAE - ENSTA
 • Estimer le prix de l'option Américaine en utilisant la méthode de Longstaff-Schwartz sous Matlab et R.
 • Estimer le prix de l'option Américaine par la méthode des différences finies sous Matlab, consistant à résoudre l'équation aux dérivées partielles que le prix satisfait.
- 2018 Valorisation d'une option asiatique (2 mois) ENSTA
 • Implémenter l'approximation de Turnbull & Wakeman en utilisant le langage C++.
 • Estimer le prix par la méthode de Monte-Carlo avec Matlab en se basant sur le modèle B&S.
 • Étudier l'influence du pas de temps utilisé, la volatilité et le taux d'intérêt sur le prix.