



Samer Said

24 ans
Ingénieur Financier

✉ 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)
- Bloomberg

Connaissances

- Apprentissage statistique
- Calcul stochastique
- Méthodes de Monte-Carlo
- Optimisation différentiable
- Gestion de portefeuille
- Trading algorithmique
- GARCH and stochastic volatility models
- Valorisation et couverture de produits 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 2 Statistique & Finance ENSAE Paris - Polytechnique X
• Parcours : Finance de marché, Gestion des risques, Pricing derivatives, Trading algorithmique, Statistique et Machine Learning.
- 2016-2019 Diplôme d'ingénieur en Mathématiques Appliquées ENSTA Paris
• Parcours : Mathématiques financières, Calcul stochastique, Chaînes de Markov, Régulation financière, Dérivés de crédit, Modèles de Régression, Séries Temporelles, Optimisation différentiable.
- 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
• Participation à la modélisation des indicateurs de risques LGD et PD.
• Développement de la librairie des modèles existants en R (Automatisation des procédures internes).
• Exécution des stress tests sur les collatéraux (déposés en garantie des crédits du groupe) et analyse des résultats.
• Amélioration des modèles existants de valorisation d'actifs maritimes en utilisant des statistiques avancées et des techniques de machine learning.
• Mise en oeuvre des tests de l'outil de modélisation et analyse de la sensibilité aux paramètres.
- Mai 2018 Stage de recherche (3 mois) Institut Louis Bachelier
• Modéliser l'erreur de prévision de la consommation nette de l'électricité en France métropolitaine sous R.
• Estimer le coût de la volatilité de la production intermittente (la production éolienne) sur les marchés day-ahead de l'électricité par des modèles économétriques.
- 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
• Estimer le prix par l'approximation de Turnbull & Wakeman sous 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.
- 2018 Simulation boursière (3 mois) ENSTA Paris
• Modélisation des transactions (achat, vente, conservation, etc.) dans la bourse sous C++.