Prénom Nom Fin.

1212, rue St-Denis prenom.nom@hec.ca

Montréal (Québec) H2T 4Z4 [www.linkedin/in/prenomnom](http://www.linkedin/in/prenomnom)

514 333-3333 Langues: français, anglais

|  |  |
| --- | --- |
| **Profil**  | * **Compétences en finance :** Évaluation d’entreprises, **gestion de portefeuille** et répartition d’actifs, analyse quantitative et qualitative de données financières, modélisation
* Capacité à élaborer et à mettre en œuvre des **méthodes de tarification** et des modèles mathématiques, probabilistes et économétriques (simulation Monte Carlo)
* **Connaissances approfondies des marchés financiers : gestion de risques (VaR, grecques)**
* Esprit d’équipe, détermination, **bon communicateur.** Habiletés d’analyse et de synthèse, **sens des priorités** et des responsabilités
* Connaissances informatiques : **Bloomberg, Matlab,** **SQL**, Python, Reuter, C++, **Stata,** Excel (VBA)
 |
| **Affiliation**  | **Candidat au titre CFA (Chartered Financial Analyst)** Niveau 1 réussi, candidat au niveau 2 **Candidat au titre FRM**  |
| **Formation**  | **Maîtrise en science de la gestion – Spécialisation : ingénierie financière Décembre 20XX****HEC Montréal** (date prévue)* Bourses d’admission HEC Montréal
* Moyenne cumulative : 3.51 / 4.3

**Baccalauréat en administration des affaires – Spécialisations : Finance et économie 20XX****HEC Montréal*** Moyenne cumulative 4.0 /4.3
 |
| **Projets universitaires en Finance** | **Répartition d’actifs pour obtenir une allocation optimale de portefeuille :*** Construire des matrices de variance covariance à partir des données historiques
* Coder un algorithme afin de coupler les vues qualitatives de la planification avec les théories quantitatives selon le champ des probabilités bayésiennes pour génère des graphiques sur la volatilité de l’index des actions sur le marché boursier ;
* Recommander un portefeuille d’actif qui répond aux besoins de l’investisseur

 **Tarification d’option afin de déceler des opportunités d’arbitrage :*** Sélectionner les méthodes de calcul selon la complexité du cas : Calcul numérique (différence finie, optimisation robuste …) simulation Monte-Carlo (Conditionnelle, Réduction de variance, Quasi …)
* Programmer des algorithmes permettant la réduction de temps de calcul et de variance ;
* Les modèles sont construits sur Matlab ou C en utilisant les forces de chacun (Propriétés graphiques, libraires disponibles, calcul vectoriel) ;

**Analyse des états financiers afin d’évaluer la santé financière d’une entreprise :** * Analyser les ratios financiers, les flux de trésorerie, les tendances, les ratios de rentabilité/liquidité, les prévisions à long terme, les ajustements conformes et non conformes aux PCGR,
* Utiliser les actifs et le rendement d'exploitation de sociétés de renoms pour préparer des rapports analytiques complets.

**Analyse du risque du marché afin de gérer l’exposition d’un portefeuille de titres composé - GE, GOOGLE et EBAY:** * Calculer le rendement du portefeuille, la VAR conditionnelle et le déficit prévu à l'aide de simulations Monte-Carlo
* Élaborer des modèles qui aboutissent à des estimations de risque à l’aide de la distribution normale multivariée et des décompositions de Cholesky et de la volatilité prévue (modèles ARCH et GARCH) en utilisant la matrice de covariance
 |
| **Expérience** | **Stagiaire en analyse de risques financiers (Projet- supervisé) Automne 20XX****Banque AAA, Montréal*** Tarifier divers produits dérivés à des fins de négociation et de gestion des risques.
* Programmer des simulations de rendements corrélés d’équité et de revenu fixe sur Matlab
* Tester plusieurs stratégies et évaluer les risques d’investissement en comparant et en optimisant les courbes d’allocation

**Réalisation :** Développement, conception et gestion de la mise en œuvre de la fonctionnalité d’un nouveau logiciel en gestion de risque afin de réduire les erreurs au moment du calcul de la VaR et du calcul des limites de contrepartie sur SQL. |
| **Implication et intérêt** | **Opérateur Sept 20XX – À ce jour****Salle des marchés, HEC Montréal** * Offrir une formation Bloomberg, fournir de l'aide pour la modélisation financière et les activités de trading RIT en plus d’appuyer les étudiants pour leurs projets en finance

**Compétition :** 3e position – Équipe universitaire pour le cas en finances de marché Omnium Finance**Gestion active d’un portefeuille personnel** (Actif de 40 000 $) **depuis 20XX** |