

Serdar SEN

Français, 26 ans

141 avenue du Général de Gaulle 77270 VILLEPARISIS

Tél : 06.17.95.70.65

Email : senserdar87@gmail.com

Site personnel : <http://www.serdarsen.somee.com>

Ingénieur Financier

FORMATIONS

- 2010-2013** **ESILV – Ecole Supérieure d'Ingénieur Léonard de Vinci, La Défense**
Titre d'ingénieur délivré par la commission des titres d'ingénieur
Spécialisation : mathématiques et ingénierie financière
- 2008-2010** **Lycée pierre de Coubertin, Meaux**
Classe préparatoire aux grandes écoles
Enseignement approfondi des sciences mathématiques
- 2007** **Lycée pierre de Coubertin, Meaux**
Obtention du baccalauréat scientifique option sciences de l'ingénieur

EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

- 2014** **Analyste Risque de marché, Société Générale**
Maintenance et amélioration des outils d'analyses et monitoring pour le périmètre Fixed Income (VBA/Excel).
Production des analyses de risques au quotidien : VaR et Stress Test.
Mise en place de nouvelles analyses de risques et Stress Tests.
- 2013** **Schelcher Prince Gestion, Analyste Quantitative Crédit (6 mois)**
Mise en place d'un outil de screening quantitatif sur le risque de crédit.
- **Mise en place d'un modèle de screening économétrique sectoriel sur les spreads de CDS.**
Décomposition du risque de défaut d'un émetteur sur différents vecteurs de risques.
Modèles de prédiction (par secteur) du spread de CDS par rapport aux vecteurs de risques.
Détermination de l'impact de chaque facteur de risque en faisant subir aux modèles des stress-tests.
Simulation de trajectoires Monte Carlo sur les modèles afin d'obtenir une distribution des variations de spread.
- **Etude comparative d'un émetteur dans son secteur**
Outil destiné à étudier la santé financière (niveau crédit) d'un émetteur dans son secteur. Elle permet de comparer les ratios financiers d'un émetteur par rapport à son secteur. Comparaison de la dette contre l'action (modèle de Merton). Screening des opportunités présentes entre les spreads de CDS et z-spreads d'obligations (base) pour les éventuels investissements des gérants crédit.
- **Etude comparative d'un secteur (bancaire, énergie, automobile....) dans l'univers global**
Outil composé essentiellement de graphiques qui résument les variations des niveaux de CDS.
Etablissement de la courbe des z-spreads d'obligations par secteur et par niveau de rating.
- **Mise en place d'un outil de gestion de base de données alimenté via Bloomberg.**
Environnement de travail : R, VBA/Excel, SQL.
- 2011-2012** **HSBC France, Commando Front Office (6 mois)**
Commando Front Office au sein de l'équipe Structured Equity Derivatives
Mise en place d'une plateforme de Trading pour les produits dérivés actions.
Plateforme destinée au desk de trading sur dérivés actions. Elle est composée de trois outils : un outil pour le pricing de stratégie sur dérivés actions, un outil de screening des stratégies optionnelles, un outil de simulation de scénario sur dérivés actions.
- Intégration des bibliothèques de pricing dans la plateforme. Mise en place des connections Bloomberg dans l'outil de pricing.
- Intégration d'un outil de screening des portefeuilles composés de stratégies sur dérivés actions.
- Mise en place d'un outil de scénario pour les stratégies sur dérivés actions.
- Amélioration des outils de monitoring permettant aux traders une exploitation rapide et efficace des informations de marché.
- Assistance auprès des opérateurs de la salle de marché.
Environnement de travail : VBA/Excel, SQL, XML.

PROJETS REALISES

- 2012-2013** Calibration de modèle et valorisation des produits (C# - ASP.NET : <http://www.serdarsen.somee.com>) :
- Constant Elasticity of Variance (CEV) : pricing, étude du smile de volatilité
- Stochastic Alpha Beta Rho (SABR) model : calibration des paramètres de marché
Mise en place d'une plateforme intégrée de trading pour Hedge Fund (VBA/Excel)
Modélisation financière des modèles de pricing avec processus de saut-diffusion (C#)
Mise en œuvre d'une VaR crédit Monte Carlo (VBA)
- 2011-2012** Pricing d'options exotiques (C++) : asiatiques, digitales, basket, Lookback.
Delta-hedging d'option digitale par approche Bull Spread (C++)
Couverture (Delta-Gamma-Vega) de produits dérivés (C#)
- 2010-2011** Evaluations d'options : modèle binomiale, Black & Scholes, Monte Carlo, différence finie (VBA, C++)
Construction de la courbe des taux zéro-coupon (C++)

COMPETENCES

- Finance :** Econométrie et séries temporelles, processus stochastiques, finance empirique avec R, Fixed Income, produits dérivés actions, produits dérivés de crédit, mesure du risque (marché, taux, crédit), gestion alternative, Advanced Fixed Income with Bloomberg, Value at Risk.
- Statistique :** Echantillonnage et estimation, modèle linéaire général et multiple, analyse des données
- Informatique :** Programmation en C++, C# (ASP.NET, WPF), VBA, SQL, R.
Microsoft Office (Word, Excel, Power Point, Access). **Bloomberg Certification.**
- Langues :** Anglais (bon niveau), Turque (maternelle), Espagnol (notion)

CENTRES D'INTERET

- Intérêt :** Cinéma, lecture, voyages, football, ping-pong, athlétisme.