

Analyste Quantitatif Senior Construction de Portefeuille et Recherche

09/05/2018

1 ERAAM

ERAAM (<http://www.eraam.com>) est une société de gestion entrepreneuriale et indépendante. Elle a été pionnière de la gestion alternative dans les années 90, aujourd'hui elle est précurseur dans la gestion dite en prime de risque (risk premia).

2 L'équipe

ERAAM est à la recherche d'un Analyste Quantitatif Sénior pour son pôle Gestion et Construction de Portefeuille et Recherche. Cette équipe est en charge la construction, l'optimisation et la gestion de la stratégie ERAAM Premia.

3 Votre mission

En collaboration avec les membres de la Recherche et de la Gestion, vous tirerez profit de vos connaissances en finance et de votre compétence en analyse quantitative, pour améliorer l'implémentation de la stratégie ERAAM Premia et pour mener une recherche innovante dans les domaines de la construction de portefeuille et de l'implémentation. En tant que membre de cette équipe vous profiterez d'un environnement stimulant et d'une culture d'entreprise moderne dans le domaine de la gestion d'actifs quantitative.

3.1 Implémentation de la stratégie ERAAM Premia

- Au sein de l'équipe de gestion
- Vous participez à l'élaboration des outils quantitatifs de gestion et de suivi des performances des fonds
- Vous participez la construction des différents poches/axes de gestion des fonds et vous analyserez leur performance au quotidien

3.2 Recherche et Développement

- En collaboration avec les équipe de recherche
- Vous contribuez à notre réflexion théorique sur les méthodes de construction (optimisation) de portefeuilles et la modélisation des risques
- A partir d'outils statistiques et financiers vous améliorez le framework existant et testez de nouvelles méthodes de construction
- Vous participez à la construction et la simulation de stratégies à partir de signaux quantitatifs
- Vous contribuez au développement de notre architecture Python de R&D

4 Votre profil

- Vous être diplômé d'une Ecole d'ingénieur ou d'un équivalent universitaire
- Vous possédez au moins 5 ans d'expérience professionnelle dans les domaines de l'analyse quantitative et/ou de la finance
- Vous disposez de compétences quantitatives de haut niveau et avez démontré votre capacité à maîtriser l'algèbre linéaire, les statistiques et les probabilités
- Vous comprenez les outils de l'économie et de la finance et avez déjà utilisez ceux-ci dans un environnement quantitatif
- Vous possédez une très bonne maîtrise du langage python. Pour le calcul scientifique et la gestion de données (numpy, pandas, scikit-learn et scipy) ainsi que l'optimisation (CVXPY)

5 Contact

- <http://www.eraam.com>
- e.michaux@eraam.com