



Hugo Bergeret, 25 ans
 bergerethugo@yahoo.fr | hugobergeret.fr | [in](#)

Diplômé du Programme Grande École de EMLYON Business School et actuellement en Master 2 de Mathématiques Financières à l'Université Panthéon-Sorbonne

PARCOURS ACADEMIQUE

2021 - 2022	Université Panthéon-Sorbonne (Paris I) <i>Master 2 MMMEF : Modélisation et Méthodes Mathématiques en Economie et Finance</i>	PARIS
<p>Cours : Calcul stochastique, Apprentissage statistique, C++, Python, Méthodes pour les EDP, Calcul de Malliavin et méthodes de Monte-Carlo, Trading algorithmique, Data Science et Big Data, Contrôle optimal, Calibration</p> <p>Projets : Pricer d'options européennes en C++, Application de méthodes de Machine Learning (PCA, régression logistique, clustering etc.)</p>		
2020 - 2021	Sorbonne Université (UPMC – Paris VI) <i>Licence 3 de Mathématiques</i>	PARIS
<p>Cours : Théorie de la mesure, Probabilités, Processus et simulation, Méthodes numériques pour les EDO, Statistiques, Python</p>		
2015 - 2020	EMLYON Business School <i>Programme Grande École spécialité finance quantitative</i>	LYON
<p>Cours : Outils quantitatifs pour la finance et l'assurance (Calcul stochastique), Statistiques, Produits dérivés, Gestion de portefeuille, Financial Risk Management, Matières premières et dérivés de crédit, VBA, R et Python</p> <p>Mémoire de fin d'études : « Mesures de risque de marché pour les produits dérivés : calcul et backtesting »</p> <p>Échange académique : XLRI School of Management en Inde</p>		
2013 - 2015	Lycée Montaigne <i>Classe préparatoire aux Grandes Écoles ECS</i>	PARIS

EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

2021 <i>Mars - Août</i>	Natixis <i>Analyste risque de marché - CDD</i>	PARIS
<p>Détection des risques non suivis sur l'ensemble des activités de trading et estimation des impacts potentiels</p> <ul style="list-style-type: none"> Analyse des produits traités par les différents desks, des stratégies de couverture, des méthodologies de calcul Design de méthodologies d'estimation d'impact sur les risques détectés en collaboration avec les quants risque : Cross Gamma EQ-FX/EQ-IR, FX Smile, Report de dividende etc. Développement de libraires Python et de notebooks pour l'import et le traitement des données risque (SQL, Hadoop, NumPy, Pandas et Matplotlib) 		
2019 <i>Mai - Septembre</i>	Edmond de Rothschild Asset Management (EdRAM) <i>Analyste risque de marché - Stage</i>	PARIS
<p>Conception et déploiement de méthodologies de stress-tests historiques et hypothétiques sur les portefeuilles</p> <ul style="list-style-type: none"> Définition des facteurs de risque des portefeuilles, calcul des chocs historiques et backtesting (Excel/VBA) Définition des stratégies d'investissement à mettre en défaut, choix des facteurs clés, simulation de chocs hypothétiques Recherche sur les méthodes évolutionnistes appliquées à la finance et implémentation d'un algorithme génétique (R) 		
2018 <i>Janvier - Juin</i>	Crédit Agricole CIB (CACIB) <i>Analyste risque XVA Market Activity Monitoring - Stage</i>	PARIS
<p>Création d'outils informatiques d'import et d'exploitation des données de risque puis analyse des indicateurs obtenus</p> <ul style="list-style-type: none"> Création d'outils pour l'import des données depuis les bibliothèques de calcul (SQL) Refonte totale des outils de calcul du P&L, des PLA et des Sensibilités CVA, FVA et LVA (Excel/VBA) Calcul et analyse des indicateurs de risque de contrepartie : P&L, PLA, Sensibilités CVA et VaR CVA 		

LANGUES, INFORMATIQUE ET CENTRES D'INTERETS

Langues	Français, Anglais (courant, TOEIC : 990/990), Espagnol (courant, 7 mois au Chili)
Informatique	Programmation : Python, R, SQL, VBA, C++ et web (HTML, CSS, JavaScript, Python avec framework Django)
Intérêts	Ski (participation à la compétition <i>Red Bull Out of Hell 2016</i>), Badminton (pratiquant et arbitre)