

Offre de poste : Ingénieur-Analyste Quantitatif (H/F)

La Société

Rivage Investment est une société de gestion de portefeuilles indépendante, installée à Paris près de la place de l'Opéra. Créée en 2010 par ses fondateurs-associés, nous sommes une équipe de professionnels pionniers dans le secteur de la dette privée et des marchés financiers. Nous avons lancé avec succès une plateforme de dette de projets d'infrastructure et d'énergie et nous gérons pour le compte de nos clients institutionnels 5,2 milliards d'euros d'actifs.

Acteur majeur sur ce segment des fonds de dette, nous continuons à croire en développant de nouveaux produits, outils et méthodologies répondant aux besoins des investisseurs et nous sommes à la recherche de talents à forts potentiels pour accompagner ce développement.

Ce que vous recherchez

Vous êtes un(e) jeune mathématicien(ne) financier ayant un double diplôme en analyse quantitative (mathématiques, ingénierie, finance, ...). Vous avez un **solide bagage théorique** et vous souhaitez à présent mettre en œuvre de façon très pratique et concrète vos connaissances fondamentales. Vos connaissances techniques sont complètes (théories mathématiques et programmation) et vous permettent de mener les projets que l'on vous confie (spécifications, modélisation, validation et industrialisation). Vous recherchez une jeune équipe dynamique et agile et vous souhaitez répondre à leurs problématiques métiers rapidement. Vous ne souhaitez pas travailler en silo pour le seul front-office, back-office ou le seul département des risques et c'est pourquoi vous privilégiez les petites structures à taille humaine où vous serez directement exposé aux problématiques de tous les départements, front to back, avec un accès privilégié et direct aux associés seniors comme juniors. Vous êtes business-driven et souhaitez apporter votre expertise et votre rigueur sur des sujets concrets : ce que vous souhaitez, c'est démarrer et réussir les projets techniques que l'on vous confie, ainsi que leur maintien en conditions opérationnelles.

La Mission

Le/la collaborateur(rice) fera partie intégrante de l'équipe de **recherche et développement** en appui du front-office (gérants) et back-office (opérations), et sera le **réfèrent en mathématiques financières** pour toutes les problématiques techniques de la société. A ce titre, le/la collaborateur(rice) aura les responsabilités suivantes :

- Responsabilités principales :
 - o Maintenir et faire évoluer les **modèles de marchés** : bootstrapping de courbes de taux d'intérêts et calculs d'analytics (qualité des données marché, discount factors, sensibilités, duration, spreads)
 - o **Modélisation de produits financiers complexes** en portefeuille, maintien des modèles de cashflow, monitoring de la qualité des données

- Rechercher, développer, calibrer, backtester et maintenir **les modèles de valorisation et d'optimisation et leurs outils** (mathématiques financières, C++, Python)
- **Contrôle et expertise** des modèles et bibliothèques de valorisation : explication/justification des résultats de nos modèles auprès des différentes fonctions métiers
- **Modélisation et risk-management** pour les fonds en détention (conception d'indicateurs de risques, ...)
- Développer et maintenir la **base de données et ses outils quantitatifs** (SQL Server, code propriétaire)
- Assurer une **veille technologique** sur la littérature scientifique, la recherche en mathématiques financières et en méthodes systèmes
- Autres responsabilités :
 - Soutenir la **gestion courante des fonctions métiers** en développant des solutions et modèles adaptés aux problèmes rencontrés
 - Documenter les modèles, en assurer leur diffusion en interne (formation aux front-office/back-office), et maintenir la documentation à jour
 - Être force de proposition dans l'amélioration et la recherche des modèles des équipes métier
- Projets à venir (exemple de missions potentielles à moyen-long terme) :
 - FX hedging strategies : études et mise en œuvre d'une stratégie de couverture FX
 - Datascience : études et mise en œuvre d'une stratégie IA (machine learning, deep learning)
 - Credit structuring : études et structuration de solution crédit (cashflow modelling, tranching, pricing, ...)

Profil du candidat

Le candidat doit être titulaire d'une solide formation en mathématiques financières Bac+5 (ingénieur et/ou universitaire, double cursus) et pourra démontrer de solides connaissances en techniques mathématiques financières et informatiques (modèles financiers, courbes de taux, probabilités, C++, SQL Server, Python, Visual Basic, ...). Il pourra justifier d'une expérience réussie d'analyste quantitatif de 1 à 3 ans, mais les profils Junior pourront aussi être considérés selon profil. Il devra faire preuve d'une grande motivation et d'un intérêt pour les marchés financiers, être capable d'autonomie, de polyvalence et d'initiative avec une rapide prise de responsabilités au sein d'une structure à taille humaine. Les qualités recherchées sont : la curiosité intellectuelle alliée à une grande rigueur, le goût de l'effort et du travail bien fait. La maîtrise de la langue anglaise est nécessaire.

Conditions et rémunération

Le poste est basé en région parisienne. Un CDI en adéquation avec le profil sera proposé au candidat. La date de début et le montant de la rémunération sont à définir et seront établis en fonction de l'expérience du candidat. L'offre est à pourvoir dès que possible.

Contact

Les candidatures doivent être envoyées à recrutement@rivageinvestment.com en précisant la référence AQIT12