



- **Société** : SUNNY ASSET MANAGEMENT
- **Lieu de travail** : Neuilly sur Seine
- **Durée de stage** : 6 mois
- **Date de début de stage** : à partir du 1^{er} Septembre 2018
- **Contact** : stage@sunny-am.com

SUNNY ASSET MANAGEMENT

Sunny Asset Management est une Société de Gestion à taille humaine et d'esprit entrepreneurial. Ses encours sous gestion sont de 600 Millions d'euros. Le savoir faire de la Société et de ses gestions repose essentiellement sur une gestion non « benchmarkée », c'est-à-dire affranchie des indices. Les actifs traités sont les taux d'intérêt, le crédit et les actions « smallcap » et « midcap ».

MISSIONS

Dans le cadre de son développement d'une expertise de gestion alternative / performance absolue, Sunny Asset Management recherche un stagiaire en ingénierie quantitative, avec des connaissances particulières sur les taux d'intérêts afin d'épauler les gérants. Vous serez particulièrement en charge :

- de modélisation des taux d'intérêts (Analyse en Composante Principales par exemple)
- du pricing de produits dérivés simples et complexes IRS Swaps, Cross Currency Basis Swaps, FX Swaps, Options simples et complexes (des connaissances de modèles stochastiques de type SABR seraient un must)
- de construction d'Outils d'aide à la décision (modèles de « momentum », modèles de retour à la moyenne de type AR, GARCH, Markov switching)
- Analyse Big Data
- Automatisation et vérification des processus de calculs et d'implémentation Bloomberg via PORT
- Mise en forme des Reporting à partir des modèles de calcul des risques (VAR, stress-tests, volatilités)

Les missions pourront être amenées à s'enrichir en fonction des capacités et de la motivation du stagiaire.

PROFIL RECHERCHE

De formation Bac +5 (ou actuellement en année de césure), de type école d'ingénieur avec une spécialisation finance ou équivalent universitaire.

Vous justifiez de premières expériences dans le secteur des banques ou de l'asset management, de connaissances financières approfondies dans le domaine des taux d'intérêt et du Forex.

Vous justifiez d'un bon niveau en programmation : VBA indispensable, Python ou C++, connaissance des langages R, Matlab, etc.

Vous faites preuve de rigueur, d'autonomie et d'organisation, et vous vous destinez aux métiers dans les domaines du Trading, de la Gestion quantitative, ou de l'ingénierie financière.