



Badr BOUALAM

38 rue Salvador Allendé Nanterre 92000,
(+33) 06.31.78.91.51, badr.boualam@gmail.com
Né le 02/06/1987

Ingenieur études et développement fonctionnel en finance quantitative.

O Depuis octobre 2010 (2 ans) : SGCIB - Paris

Equipe pricing/analyse de risque Creder et IRD

Sur l'application de calcul et d'analyse de risques du desk dérivés de crédit

- O** Analyse fonctionnelle :
 - O** Recueil du besoin auprès des traders
 - O** Compréhension du pricing et détermination des données de marchés
 - O** Mise en évidence des effets dans l'explication du Pnl (corrélation, spread, taux, effets croisés)
- O** Rédaction de spécifications techniques et fonctionnelles en lien avec l'équipe
- O** Etude d'impact sur la valorisation des paramètres
- O** Conception et développement (C++/Java)
- O** Réalisation des tests unitaires
- O** Support auprès des traders

Projet :

- O** Développement du module permettant d'expliquer le Pnl en blocks multi effet
- O** Développement du module permettant l'interpolation de corrélation suivant une fonction de poids relative au sensis
- O** Développement du module de calcul à la volée des coefficients de reascling permettant le pricing des CDO tranche d'indice en mode unsplit.
- O** Développement du module de récupération des données de marché pour améliorer les performances des calculs (future, taux de refi, spread cds)

*Technologies utilisées : C++, Java Sql, Grid computing Symphony, ClearCase Git,
Environnement fonctionnel : Pnl*

O De février à août 2010 (6 mois) : CSC - Paris

Equipe Architecture SI et haute disponibilité

Garantir un système de haute disponibilité

- Analyse du cahier des charges et mise à jour du dossier de conception détaillée
- Identification des défaillances du système dans une optique de haute disponibilité
- Analyse des impacts de ces défaillances sur le système
- Analyse inter-socle applicatif : progiciel PSFT et Ti@mp, Business Object, PFI (DATAstage)
- Automatisation des tests (scripting)
- Organisation de 5 plans de tests : Rédaction, planification et coordination
- Suivi des cahiers de recette pour les campagnes : Bascule matériel, Bascule cluster OS et Bascule Logiciel.
- Validation de la couche N4 (Bascule applicatif en silo) et N5 (applicatif inter-composants) :
 - Rédaction de scénarios de test et du cahier de recette pour la validation des couches Bascule applicatif en silo et applicatif inter-composants avec Quality Center
 - Création de scripts Shell pour la validation du script de simulation de défaillances et du script d'automatisation pour la montée en charge
- Réalisation d'une cartographie des services

Technologies utilisées : J2EE, Système de Clustering MSCS CLusterSuite PowerH, Architecture SOI, Quality Center, Architecture de haute disponibilité

○ Compétences fonctionnelles :

Produits : Dérivés de crédit, CDS,CDO, CDS Index, tranche d'indice, FTD, vanille de taux

Modélisation : Black&Sholes, Modele Copules Gaussiennes, Monte Carlo

○ Compétences techniques :

Langages: Java, C/C++, Shell, SQL

Systèmes: Windows, Linux

Réseaux : TCP/IP, LAN/WAN, QoS, sécurité

Bases de données : MySQL

Modèles : UML

Outils : Quality Center, Visual Studio, Eclipse, Netbeans, Symphony, ClearCase Git

Méthodes : Agiles

○ Formation

2012 : Master Gestion de capitaux – CNAM (en cours de validation)

2010 : Ingénieur ENSIMAG – Option Architecture distribuée

O Langues

Anglais : courant

Arabe : Avancé

O Disponibilité :

Immédiate