

AKOLYS

FICHE DE POSTE NATIXIS

Premier profile

Nous recherchons un Développeur C# Senior pour rejoindre notre équipe dédiée à la conception et au développement d'une application de pricing pour les produits structurés et exotiques sur Equity, avec intégration dans Sophis, un système de gestion des positions front-to-back.

Le candidat retenu sera en charge du développement, de l'optimisation des modules de Pricing, ainsi que de du Booking des flux dans un système complet Front-to-Back. Vous travaillerez en étroite collaboration avec les équipes sales, quant, trading, librairies pour garantir l'efficacité et la précision des calculs.

Missions principales :

- Développement des nouveaux produits structurés demandés par la vente sur la base de la termsheet dans l'application.
- Modélisation des produits financiers complexes en collaboration avec les quants et les traders.
- Modularisation de l'application en vue de la rendre plus scalable (Apisation des modules).
- Intégration des flux de données et des opérations dans un système Front-to-Back.
- Optimisation des performances de l'application (algorithmes, temps de calcul).
- Collaboration avec les équipes de quant et d'architecture pour assurer la scalabilité et la robustesse de l'application.
- Documentation technique et veille technologique sur les innovations en matière de produits structurés et d'outils de pricing.

Compétences requises :

- Excellente maîtrise de C# et bonne connaissance de C++.
- Connaissance approfondie des produits structurés et des produits exotiques sur Equity.
- Maîtrise des techniques de pricing : méthode de Monte Carlo, formules fermées telles que Black-Scholes.
- Expérience avec les systèmes de pretrade et la descente des produits dans un système Front-to-Back.
- Solides compétences en architecture logicielle et optimisation du code (multithreading, scalabilité, gestion mémoire).
- Bonne compréhension des environnements de marchés financiers et des pratiques en matière de gestion de position.
- Anglais professionnel (écrit et oral), car l'environnement est international.

Deuxième profile

Au sein du pôle Pricing & Analytics de l'IT Global Markets, vous rejoindrez l'équipe Pre Trade Pricing Solutions en tant que Développeur IT Quant

La mission consiste à intervenir en tant que développeur IT Quant sur les composants de pricing MARS en relation avec le Front-Office et les Risk. MARS a pour objectif la production des indicateurs de risque de contrepartie XVA en forte connectivité avec les librairies de pricing implémentés par les ingénieurs quantitatifs XVA. Ces indicateurs sont consommés par le desk de trading XVA ainsi que les équipes d'analystes de risque (de marché, crédit et contrepartie).

Vos missions :

- Faire évoluer les composants de pricing MARS basés sur les librairies quantitatives pour des usages Front Office ainsi que Risques & Résultats.
- Optimiser l'exécution des pricers grâce à l'utilisation de solutions de parallélisation des calculs (Grid Computing) et de distribution des traitements de données.
- Participer au maintien d'une production de haute qualité en s'assurant du respect des bonnes pratiques (respect des procédures, analyse d'impacts, couverture de tests, validation business, ...) et de la gestion proactive des incidents applicatifs et d'infrastructure en suivant les plans d'actions mis en place.
- Gérer la dette technique sur son périmètre en encourageant des actions de remédiation et d'amélioration continue en accord avec les partenaires business.
- Participer à l'amélioration continue de la CI/CD en se basant sur l'agilité et les principes du DevOps
- Participer à la veille technologique en adéquation avec les dernières évolutions et innovations IT (Organisation apprenante).

Expertises spécifiques :

Disposer également de bonnes notions en finance de marchés (Taux, equity, crédit)

A l'aise avec les méthodologies Agile.

- C#/.NET Core/Framework ;
- APIs REST / Web Services ;
- SQL et les bases relationnelles.

Langages de programmation : en plus du C# des connaissances/expérience sur C++ sont nécessaires pour s'interfacer avec d'autres systèmes de pricing, connaissances/expérience sur Java (une première expérience sur Scala serait un avantage pour prendre en main rapidement les composants basés sur le système de processing distribué Apache Spark).

Environnement de développement : Visual Studio, IntelliJ

Stack DevOps : GIT/Bitbucket, Jenkins, XLDeploy/XLRelease

Framework agile: Kaban/Jira

Solutions BigData: plateforme Hadoop/Apache Spark

Grid Computing: DataSynapse/ArmoniK

Doté-e d'une bonne rigueur et d'une grande réactivité, vous avez le sens de la communication.

Anticiper et prendre des initiatives.

Avoir l' esprit d'analyse et de synthèse.