

# Eric Nicolas

39 ans, nationalité française

**T** 01 58 97 16 17

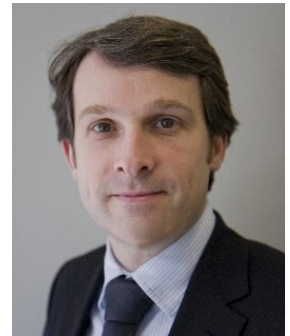
**M** 06 74 45 82 85

erik.nicolas@gmail.com

www.erik-n.net

## Front office dérivés action, 16 ans d'expérience

- Dérivés actions : analyse quantitative, pricing, stratégies, analyse des risques
- Management : recrutement, gestion et motivation des équipes, suivi de projet
- Architecture et développement logiciel



## Expériences

**Paris, 2007 - présent**

### Contrôleur des risques – THEAM / BNP Paribas

*Fonds structurés actifs et passifs, alternatifs (50 milliards d'Euros sous gestion, 1 000 fonds).*

Contre-valorisation indépendante de tous les instruments dérivés. Négociation des valorisations en écart avec les contreparties.

Etude et validation avec la Structuration, le Juridique, la Conformité de tous les projets de nouveaux fonds. Suivi des risques après lancement : respect des ratios règlementaires, suivi de l'engagement, de la VaR, de la liquidité, du risque de contrepartie, des garanties.

Refonte post-fusion des outils de valorisation et de suivi. Refonte du cahier de procédures.

*Référence* : M. Mojaisky – C.O.O. de THEAM

### Contrôleur des risques – Harewood AM / BNP Paribas

*Fonds structurés passifs et fonds de fonds (4 milliards d'Euros sous gestion, 200 fonds).*

Mise en place du contrôle des risques : méthodologie et outils associés.

Acquisition automatique de données depuis les fournisseurs (Bloomberg, Reuters, Markit...), intégration et validation d'un nouveau moteur de Monte Carlo, optimisation dynamique de panier selon des méthodes de frontière efficiente.

*Référence* : M. Mojaisky – Directeur général de Harewood AM

**Tokyo, 2005 - 2007**

### Trader – BNP Paribas

Mise en place de la plate-forme de trading automatique sur le marché Coréen. Archivage des historiques de données de marché, validation en back testing et mise en œuvre de stratégies de trading.

Trading dans l'équipe de market making : prise de positions sur les options Kospi 200. Explication de P&L. Stratégies de réplification de variance.

*Référence* : M. Kasten – Responsable du trading dérivés actions

**Paris, 2002 - 2005**

### Chef de projet, Architecte – BNP Paribas

Responsable de l'architecture technique des logiciels front office. Spécification et mise en œuvre de composants communs (connection aux flux temps réels, passage d'ordres, middleware propriétaire sur base Tibco Rendez-vous, intégration Corba...). Technologies innovantes (ACE, QT, programmation distribuée).

Responsable de la suite d'applications de Market Making pour le trading sur les pays France, Royaume-Uni, Hollande, Japon et Hong-Kong. Refonte des automates de trading en coopération avec les opérateurs de marché et la recherche.

*Référence* : M. Tyc – Responsable de la recherche quantitative

**Paris, 2001 - 2002**

### Associé et directeur technique – Next generation market

Cofondateur et associé majoritaire. Solutions de valorisation d'ABS/MBS. Responsable de la stratégie technique. Consulting financier et technique.

**Paris, 2000 - présent**    **Associé – Aventures Intérieures (www.dvdfr.com)**

Cofondateur et associé majoritaire. Création et gestion de bases de données dans les domaines du DVD, de la Musique et des Jeux Vidéo. Références clients : Price Minister, Amazon, Allociné.

**Londres, 2000 - 2001**    **Responsable e-commerce – BNP Paribas Fixed Income**

Responsable de la maîtrise d'œuvre du groupe e-commerce (cible : 700 opérateurs de marchés, équipe de 30 personnes). Création d'une offre de services Intranet et Internet incluant le passage d'ordres par le web et la connexion d'une dizaine de systèmes de trading hétérogènes.

**Paris, 1996 - 2000**    **Développeur – BNP**

Migrations d'un logiciel de pricing front-office de produits dérivés de taux d'Unix vers Windows NT puis de C vers C++. Interface MsExcel, calcul distribué sur un cluster de machines hétérogènes. Mise en place d'un site Web intranet.

---

## Diplômes et formation

**1992 - 1995**    **Sup'Optique – Ingénieur et DEA**

Option traitement des images.  
DEA optique et photonique de l'université d'Orsay.

**2009**    **CNAM – Master M2 de finance de marchés**

GFN 203    Marchés financiers I : Produits de taux, gestion de portefeuille (2<sup>ème</sup> / 206)  
GFN 204    Marchés financiers II : Futures et options  
GFN 227    Macroéconomie financière et analyse de la conjoncture  
GFN 213    Probabilités et statistiques pour la finance (1<sup>er</sup> / 37)  
ESSEC T3    Gestion de portefeuille (1<sup>er</sup> / 9)

## Langues

Anglais    Courant  
Espagnol    Notions  
Japonais    Notions

---

## Intérêts

### Photographie

Blog photographique erik-n.blogspot.com/

### Cinéma, DVD

Créateur de [www.dvdfr.com/](http://www.dvdfr.com/), 1<sup>er</sup> site indépendant d'information sur le DVD en France (600 000 pages vues par mois).

### Musique

Médaille d'or de flûte traversière au Conservatoire National Régional de Poitiers, en 1990.  
1<sup>ère</sup> flûte au Chœur et Orchestre des Grandes Ecoles en 1994 et 1995.

### Informatique

Utilisation et développement de logiciels libres :  
EasyXLL    [erik-n.net/software/easyxll/](http://erik-n.net/software/easyxll/)  
iFindSpace    [erik-n.net/software/iFindSpace/](http://erik-n.net/software/iFindSpace/)  
Conjugue    [erik-n.net/software/conjugue/](http://erik-n.net/software/conjugue/)  
Sword    [erik-n.net/software/sword/](http://erik-n.net/software/sword/)

### Voyages, lecture