

# Eric Nicolas

46 ans, nationalité française

06 74 45 82 85  
eric@famille-nicolas.fr

## Profile

Front office Global Markets + Développement logiciel, 22 ans d'expérience

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



---

## Expériences

### Paris, 2015 – présent **Structureur Indices Global Markets – BNP Paribas**

L'équipe Quantitative Investment Strategies gère plus de 2500 indices couvrant toutes les classes d'actifs, tous clients et géographies.

Au sein de cette équipe, en tant que Structureur senior : prise en charge de tous les aspects des indices propriétaires. Analyses de données, test et sélection d'algorithmes, mise en production, analyses de performances et reporting, documentation juridique, répliquabilité en coopération avec les opérateurs de marché.

Spécialisation sur les algorithmes de sélection d'action, sur les stratégies à base d'options en couverture ou en moteur de performance, stratégie de change de type *carry* ou *value*.

En charge de l'infrastructure transversale et des projets spéciaux pour l'équipe, coordinateur des équipes I.T., Recherche, Juridiques. Veille réglementaire.

### Paris, 2007 - 2015 **Responsable du contrôle des risques – 1000 fonds, 40 mds € – THEAM / BNP Paribas**

Contre-valorisation indépendante de tous les instruments dérivés au sein de fonds. Négociation des valorisations en écart avec les contreparties. Intégration de données de marché (Bloomberg, Markit...). Monte Carlo. Stratégies quantitatives.

Analyse de projets en collaboration avec la structuration, le juridique, la conformité. Suivi quotidien des risques : ratios réglementaires, VaR, liquidité, risque de contrepartie, collatéral. Reportings internes et externes (comité risque, AIFM, EMIR, ESMA).

Développement de la suite logicielle associée (300k lignes de Java). Tenue du cahier de procédure.

### Tokyo, 2005 - 2007 **Quant Trader – BNP Paribas Equity & Derivatives**

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 (C++, QT, ACE, Tibco RV).

Trading dans l'équipe de market making KS200 : prise de positions sur la volatilité, explication de P&L, stratégies de répliquabilité de variance.

### Paris, 2002 - 2005 **Chef de projet, Architecte – BNP Paribas Equity & Derivatives**

Responsable de l'architecture technique des logiciels front office. Spécification et mise en œuvre de composants communs (flux temps réels, passage d'ordres, middleware propriétaire). Technologies innovantes (C++, ACE, QT, programmation distribuée).

Management de l'équipe de développement d'application pour les market-makers dérivés actions. Prototypage d'un nouvel environnement d'automates de trading.

**Londres, 1999 - 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 développeurs). Création d'une offre de services Intranet et Internet incluant le passage d'ordres par le web. Connexion d'une dizaine de systèmes de trading hétérogènes. Déploiement de technologies C++, Java, CORBA, ASP, VBScript, COM, SQL.

**Paris, 1996 - 1999    Développeur, librairies quant – BNP**

## **Entreprenariat**

**Paris, 2000 - 2017    Co-fondateur et associé – Aventures Intérieures (www.dvdfr.com)**

Fourniture de données dans le domaine du DVD. Responsable de l'infrastructure technique et des liens B2B (Java, SQL, PHP). Références clients : Price Minister, Amazon, Allociné.

**Paris, 2001 - 2002    Co-fondateur, associé et directeur technique – Next generation market**

Solutions de valorisation d'ABS/MBS. Responsable de la stratégie technique et des interfaces de la librairie de calcul (Excel, PHP, ASP, pricers web). Consulting technique C++, SQL, Web, Excel.

---

## **Diplômes et formation**

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

Produits de taux, gestion de portefeuille (2<sup>ème</sup> / 206). Futures et options Probabilités et statistiques pour la finance (1<sup>er</sup> / 37). Gestion efficace de portefeuille (1<sup>er</sup> / 9).

**2006    License de trading au Japon (JSDA)**

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

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

### **Informatique**

Expertise en Java, C, C++, C#, QT, Unity  
Bonne connaissance de SQL, Python, PHP, HTML, CSS, VBA  
Utilisateur de CMake, Dbus, Freetype, FFMpeg, ICU, ACE, SDL, CVS, SVN  
  
Développement de logiciels libres, voir erik-n.net/software/

### **Langues**

Anglais    Courant  
Espagnol    Notions

---

## **Intérêts**

### **Cinéma**

Créateur de www.dvdfr.com, site indépendant d'information sur le DVD en France (350 000+ 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.  
Audiophile.