

Vincent Nazzareno

+33 6 14 87 57 11

✉ vincent.nazzareno@gmail.com

🌐 [linkedin.com/in/vincent-nazzareno](https://www.linkedin.com/in/vincent-nazzareno)

🐙 [GitHub](#)

Stage de 6 mois à partir de janvier 2025 en France - Étudiant en M2 Finance Quantitative à l'ESILV

Compétences en pricing d'assets (rates/equity derivatives), automatisation de processus, analyse quantitative, et machine learning (Regression, Forêt Aléatoire, NN, NLP, LLM).

Éducation

École d'Ingénieurs ESILV

Sept. 2021 – Août 2025

Master of Science en Finance Quantitative

Paris, France

- Cours pertinents : Calcul Stochastique (Probabilités, Dérivés, Taux d'intérêt), Risque de Crédit (Modèle de Merton), Risque de Marché (VaR, CVaR, XVA), Pricing, Couverture, Calibration de Modèles, Allocation d'Actifs, Commodities
- Échange Erasmus (Suède) : Analytical Finance II (Fixed Income), Statistiques Multivariées et Analyse des Données
- Langues : Français (Natif), Anglais (Courant)

Expérience Professionnelle

Stagiaire Analyste Quantitatif ML Fixed Income

Sept. 2023 – Déc. 2023

Candriam

Paris, France

- Amélioration de modèles ML pour le bootstrap de la courbe des taux US attendue à 1 an afin d'aider les gérants de portefeuille dans leur prise de décision.
- Développement de solides compétences en machine learning appliqué à la finance quantitative (fixed-income)

Stagiaire Ingénieur Recherche en Machine Learning

Déc. 2023 – Mai 2024

Groupe ADP

Paris, France

- Développement de modèles de prévision de séries temporelles pour améliorer les prévisions à 8 semaines de flux de passagers et de fréquentation des aéroports. Amélioration de la précision aux pics (25%)
- Automatisation des workflows pour le traitement et l'analyse de données structurées en Python, création d'un outil de reporting interactif utilisant le framework Streamlit.

Stagiaire Développeur Front Office Fixed Income VBA

Avr. 2023 – Sept. 2023

Candriam

Paris, France

- Conception d'une architecture de base de données pour les analystes fondamentaux, quantitatifs et risques, améliorant l'accessibilité d'indicateurs.
- Conception de scripts SQL pour du reporting et création de fiches émetteurs.
- Réalisation de tests de sécurité et de performance (injections) de l'infrastructure de base de données.

Projets

Analyse de Portefeuille de Crowd Lending avec Monte Carlo et Machine Learning

Juillet 2024

- Conception de modèles ML pour évaluer risque de contrepartie sur portefeuilles crowd lending.
- Stress test par utilisation de simulations de Monte Carlo.
- Data mining qualitatifs en utilisant des techniques NLP (modèle LLM local).

Bootstrap de la Courbe SOFR

Oct. 2024

- Développement d'un outil Python pour le bootstrap des courbes de taux swap SOFR.

Deep Pricing des Contrats d'Option

Oct. 2024

- Rédaction d'un rapport type papier de recherche, pour le deep pricing d'option deep ITM et OTM. Notebook python
- Techniques de prétraitement (Over-Sampling, Outliers Removal), rolling z-score, optimisation d'hyperparamètres
- Implémentation d'un pipeline NN (ANN, CNN, Transformers mutliheads) du training jusqu'à la prédiction.

Compétences

Langages de Programmation : Python, VBA, SQL, C++, R

Frameworks et Bibliothèques : scikit-learn, TensorFlow, Keras, Torch, RiskFolioLib, Pyfolio, QuantLib, Streamlit

Outils : GitHub, Bloomberg Terminal, PowerBI, Différentes APIs

Compétences Financières : Analyse de Crédit, Évaluation des Risques, Fixed Income, VaR/CVaR, Modélisation Stochastique, Stress-Tests