

# Gaspard Verduron

22 Chemin des Roses  
92150 SURESNES  
Tel : 06 72 63 70 02  
e-mail: gaspard.verduron@gmail.com

23 ans,  
célibataire

## FORMATION

- 2009 **Master 2 de Gestion 222-Dauphine Asset Management dirigé par Elyes Jouini**  
Université Paris 9 Dauphine  
*Méthodes quantitatives, arbitrage de volatilité, produits dérivés, gestion indicielle, gestion structurée, gestion alternative, gestion avancée de produits de taux, risque de crédit, asset-backed securities, outils d'analyse du Front Office, allocation d'actifs, économétrie des séries financières, analyse financière, application financières en VBA.*
- 2009 **Master MASEF dirigé par Bruno Bouchard (Mathématiques de la Finance de l'Economie et de l'Assurance)**  
**Certificat de gestion quantitative**  
Université Paris 9 Dauphine et ENSAE  
*Evaluation d'actifs et arbitrage, calculs stochastiques, méthode de Monte Carlo, méthodes mathématiques appliquées à la gestion alternative.*
- 2008 **Master 1 Mathématiques de la Modélisation et de la Décision (filière économie finance)**  
Université Paris 9 Dauphine  
*Processus stochastiques discrets et continus, évaluation d'actifs, modèles linéaires, analyse fonctionnelle, économétrie, économie du risque, gestion de portefeuille, contrôle des chaînes de Markov.*
- 2004 **Baccalauréat S**

## EXPERIENCES

- 2009 **Stage Fundquest (1 an- Assistant analyste fonds dans l'équipe Paris Fundquest Advisory)**  
*Filiale de BNP IP spécialisée en Mutigestion – 200 personnes*
- Etudes quantitatives et qualitatives de fonds
  - Utilisation de scorings pour sélectionner des fonds adaptés aux besoins des clients
  - Mise en place d'un process quantitatif de suivi de fonds
  - Design d'une factsheet quantitative
  - Construction de Peer Groups
  - Rédaction de notes d'information à destination des clients concernant les événements affectant les fonds.
  - Participation à de nombreux comités de sélection et d'allocations.
  - Backtesting d'une méthode statistique de classification de fonds.
- 2007-2008 **Stage Zeliade Systems (5 mois puis un jour par semaine pendant un an) :**  
*Startup de L'INRIA spécialisée dans le développement de composants logiciels pour le front office - 10 personnes*
- Etude et classification de produits dérivés (crédit, inflation, taux d'intérêt, actions)
  - Participation à la « couche produit » d'applications de pricing :
    - o Comparaison des prix retournés par l'application avec ceux du marché.
    - o Tests sur la « cohérence financière » des prix retournés.
    - o Conception de documentation pour les clients.
    - o Amélioration de l'ergonomie de l'application.
    - o Design de fiches produit
- Depuis 2004 Cours de mathématiques à domicile

## COMPETENCES INFORMATIQUES, MEMOIRE ET LANGUES

- Informatique: **Word, Excel, PowerPoint, VBA, Bloomberg.**
- Mémoire : **Monte Carlo** : Calculs des grecs d'options vanilles en VBA par diverses méthodes (différence finie, processus tangent et Malliavin), puis comparaison et analyse des résultats retournés.
- Langues: **Anglais** courant , **Allemand** scolaire

## INFORMATIONS COMPLEMENTAIRES

- Associatifs: Coorganisateur de la conférence annuelle du Master 222 :  
« Ont-ils tué le Capitalisme » avec comme intervenants Claude Bébéar, Lionel Zinsou, Patrick Artus et Jean-Paul Betbèze
- Sports : Pratique du Handball depuis 13 ans.