



Développement d'une application d'interpolation et de calibration des surfaces de volatilités

Ingénieur(e) R&D – Développeur(se) C#

Qui sommes-nous ?

Kesitys est une startup FinTech qui s'est donnée pour mission d'apporter des solutions mathématiques innovantes pour optimiser et automatiser certaines étapes complexes des activités de trading.

L'histoire de **Kesitys** repose sur une équipe de chercheurs, passionnés et experts dans leurs domaines, qui s'est attaquée il y a plusieurs années aux problèmes de la gestion des risques des produits dérivés, et plus particulièrement à son optimisation et son automatisation.

La gestion des risques est une étape complexe et à laquelle de nombreuses questions sont rattachées : quels instruments utiliser pour couvrir mes options ? En quelle quantité dois-je en acheter/vendre ? Et surtout ... quand dois-je agir ?

Au fil des années, des réponses mathématiques ont été apportées aux deux premières questions, en revanche la dernière semblait toujours non résolue. A ce problème, aussi complexe à modéliser qu'à résoudre en raison du nombre de paramètres (de marché, de risque etc.) à prendre en compte, notre équipe a trouvé une solution qui est aujourd'hui commercialisée sous le nom de **TEMPO**.

Au cœur de l'écosystème startup, nos bureaux se situent dans l'incubateur spécialisé Fintech Le Swave de Paris&Co, au 19ème étage de la Grande Arche de La Défense. Cet environnement stimulant nous offre la possibilité de participer à des conférences autour de la Finance et de ses innovations, et d'échanger avec d'autres startups et acteurs du marché.

Notre équipe, composée actuellement de 5 personnes, a pour volonté d'aller toujours plus loin dans la recherche pour fournir à nos clients des produits innovants, performants et réellement adaptés à leurs besoins. C'est dans ce but que nous recherchons actuellement plusieurs ingénieurs, motivés pour rejoindre notre équipe afin de participer au développement de nos solutions.

Description du poste et des missions

Chez **Kesitys**, nous avons la chance d'avoir une super équipe, composée de développeurs expérimentés et de chercheurs reconnus dans leurs domaines. **Nous te proposons donc de participer à notre aventure et d'apprendre à nos côtés en contribuant au développement de nos produits et des nouvelles fonctionnalités à proposer à nos clients.**

Plus précisément, tes principales missions seront de :

- Développer en C# un module complet d'interpolation et de calibration de surfaces de volatilité :
 - ✓ Développement du cœur de calcul à partir des résultats de notre équipe de recherche
 - ✓ Conception d'une API et d'une interface graphique
 - ✓ Tests unitaires et d'intégration
 - ✓ Rédaction de la documentation utilisateur associée
- Participer à la conception et au développement de nos nouveaux produits et fonctionnalités ;

Le profil recherché

Les compétences requises :

- Formation Bac +5, diplôme en cours d'une Ecole d'ingénieurs ou d'un Master Spécialisé en Mathématiques Appliquées et Finance
- A l'aise avec la programmation en C# (ou à défaut en C++ ou Java), tu es capable de concevoir et implémenter des programmes avec une architecture robuste et maintenable.
- Bonnes connaissances en Finance (instruments financiers, modèles classiques de pricing etc.)

Les principales qualités et atouts recherchés :

- Grande autonomie
- Rigoureux(se), organisé(e)
- Sociable et aimant le travail en équipe
- Dynamique, souriant(e) et très motivé(e) !

En résumé

- **Kesitys** : une FinTech en plein développement, une équipe dynamique et motivée ; et plein de beaux challenges à relever.
- Lieu : Paris, Incubateur Le Swave, situé au 19^{ème} étage de la Grande Arche De La Défense (entourés de plusieurs dizaines d'autres startups de la finance !)
- Contrat : Stage de 6 mois minimum
- Début du contrat souhaité : premier semestre 2020
- Rémunération : en fonction du profil
- Niveau de qualification : Bac+5 / Master

A toi !

Nous attendons avec impatience ton CV et lettre de motivation, à envoyer à jobs@kesity.com

