



**QUANT MATHÉMATIQUES FINANCIÈRES (CDI)**  
—  
**MARCHÉS ÉNERGIE ET MARCHÉS FINANCIERS**

- **Direction, Unité, Service :**  
Direction Recherche et Développement  
Département Optimisation, Simulation Risque et Statistiques (OSIRIS)
- **Coordonnées de l'interlocuteur à contacter (Nom, emploi, téléphone, télécopie) :**  
**Edouard Lavillonnière**, Chef du Groupe « Gestion des Risques Marchés et Valorisation »  
Tél. : 01.78.19.40.04  
e-mail : edouard.lavillonniere@edf.fr
- **Lieu de travail :**  
7 BD GASPARD MONGE, 91120 PALAISEAU
- **Type de contrat de travail :** CDI
- **Date souhaitée de pourvoi de l'emploi :** 1<sup>er</sup> juin 2021
- **Environnement de l'emploi (domaine d'activité, caractéristiques de l'unité, du service, de l'équipe...) :**

La R&D du Groupe EDF recrute ! Vous avez envie de travailler au cœur des enjeux stratégiques du secteur de l'énergie? Rejoignez la R&D en tant que **chargé d'études**, pour relever les nombreux défis autour des **marchés d'énergie et marchés financiers** !

Vous faites partie du groupe « Gestion des Risques Marchés et Valorisation », une équipe dynamique de 23 ingénieurs financiers qui accompagnent au quotidien plusieurs directions stratégiques de l'entreprise, rattachée au département OSIRIS (Optimisation, Simulation, Risques et Statistiques pour les marchés de l'énergie).

Vos missions :

- vous **réalisez** des études quantitatives reposant sur la modélisation des portefeuilles énergie et des portefeuilles financiers du Groupe EDF :
  - Pour la partie **marchés énergie** : la réalisation d'études quantitatives innovantes reposant sur la modélisation des portefeuilles énergie d'EDF et de ses filiales (optimisation des actifs, commercialisation), la simulation des aléas sur les marchés énergie (y compris prise en compte des spécificités de marchés : contraintes de liquidité, imperfections, coûts de transactions, équilibre offre/demande...), le pricing de contrats/actifs optionnels...
  - Pour la partie **marchés financiers** : la mise au point de nouvelles méthodes pour la gestion des portefeuilles financiers (actions, obligations, taux de change, taux d'intérêt, inflation...), par approche rendement-risque pour la gestion actif/passif (Assets & Liabilities Management: environ 45Md€ de titres sous gestion en actifs dédiés et environ 35Md€ de portefeuille de dette financière nette).
- vous **mettez au point** de nouveaux modèles d'aléas et de nouvelles **stratégies** de couverture des risques



- vous étudiez de nouvelles techniques en **datasciences, intelligence artificielle** (machine learning, deep learning, renforcement...)
- le cas échéant, vous **implémentez** de nouvelles fonctionnalités associées dans les outils utilisés par les entités opérationnelles
- vous **interagissez** avec les entités opérationnelles, dans le but de comprendre leurs enjeux et de répondre efficacement à leurs besoins

En fonction de votre expérience et de vos ambitions, vous pourrez vous voir confier des missions transverses :

- appuyez spécifiquement une filiale **internationale** du Groupe EDF,
- **valorisez** le savoir-faire en dehors du Groupe EDF (nouveaux clients à l'international),
- **développez** un module de formation
- **pilotez** une activité
- **encadrez** alternant(s) et/ou stagiaire(s)

Vous bénéficierez dès votre prise de fonction des **formations** nécessaires à l'exercice de votre métier. Le Groupe offre de nombreuses opportunités de carrière, professionnelles et géographiques. Vous pourrez **évoluer** dans la filière Projets ou rejoindre la filière Expertise.

#### Profil souhaité

Vous aimez le temps réel et le fonctionnement en mode Projet ?

Vous disposez :

- d'un socle de connaissances techniques en **mathématiques appliquées**. Des compétences en développement informatique ou en finance de marché seraient un plus.
- de **capacités d'analyse** et de prise de recul,
- d'un goût prononcé pour **travailler en équipe** et collaborer,
- d'un sens de **l'écoute** et du dialogue,
- de **réactivité** et d'adaptabilité.

Vous savez :

- prendre du recul, comprendre et **prioriser les enjeux**, anticiper les difficultés
- identifier et **exploiter les marges de manœuvre** à votre disposition,
- donner du sens à **l'action**, incarner les exigences,
- **exprimer votre point de vue** auprès d'interlocuteurs variés, de manière posée et argumentée,
- prendre des **décisions** et assurer un reporting pertinent au bon niveau.

Anglais indispensable.

#### Formation :

Ecole d'ingénieurs, master ou doctorat en **mathématiques financières/statistiques/mathématiques appliquées**