

LUCAS LEBIHAN

Ingénieur Quantitatif — Actions, ETFs & Dérivés | Pricing & Risque en Production

@ lucaslebianpro@gmail.com

| in linkedin.com/in/lucasclebian

| github.com/HtFilia



EXPÉRIENCE

Ingénieur Quantitatif

BNP Paribas

📅 Sep 2024 - Aujourd'hui

📍 Paris, France

» Pricing & analytics risque front-office:

- > Bibliothèques Python de pricing TRF sur indices actions EU/US, couvrant ajustements de dividendes et opérations sur titres
- > Pipelines d'exposition delta cross-assets (ETFs, futures, swaps, options actions) permettant la normalisation des Greeks entre books
- > Analytics d'exposition delta permettant aux traders de calculer leurs positions de couverture optimales sur plusieurs millions d'euros de notionnel

» Architecture système & performance:

- > Microservice FX haute disponibilité pour le PnL Mark-to-Market sur l'ensemble des books, avec latence inférieure à 20 ms et failover actif
- > Refactorisation du moteur d'agrégation des dividendes de complexité quadratique à linéaire, réduisant le runtime de 50 % et la mémoire de 95 %

» Recherche quantitative & validation de modèles:

- > Routines de rééquilibrage de paniers pour réaligner les compositions d'indices post-opérations sur titres et mises à jour client, préservant la couverture delta-neutre
- > Suivi du tracking error et réconciliation des expositions ETF contre leurs indices, améliorant la réplique indicielle et l'attribution du PnL

Tools: Python, GNU/Linux, Excel, Ada, Go

Ingénieur Logiciel

Murex

📅 Mar 2021 - Sep 2024

📍 Paris, France

» Plateforme de trading & ingénierie API:

- > APIs REST à faible latence pour MX.3, permettant le routage d'ordres en temps réel, la gestion des positions et la synchronisation via le protocole FIX
- > Intégration de services nouveaux et legacy dans MX.3 via architecture événementielle, garantissant la cohérence des données et réduisant la latence de traitement

» Performance système & fiabilité:

- > Couche de cache multi-threadée concurrente améliorant le débit API et la latence p99 sous charge maximale en heures de trading
- > Standardisation des pipelines CI/CD et versionnement de schémas sur Oracle, Sybase et PostgreSQL via Liquibase, éliminant les dérives de migration

Tools: Java, Spring Boot, C++, REST

FORMATION & CERTIFICATIONS

Master en Génie Logiciel

ENSIMAG

Master en Finance Quantitative

IAE Grenoble

Certification AMF (Avr 2025)

COMPÉTENCES TECHNIQUES

Programmation: Java Python Go APIs REST

Données & Infrastructure: PostgreSQL Redis

MongoDB Unix

Outils Quantitatifs: Pricing d'Options

Simulation Monte Carlo Modélisation Stochastique

Backtesting VaR

Finance: ETFs Dérivés Actions Gestion des Risques

Couverture Delta Pricing Valorisation

PROJETS PERSONNELS

» **Simulateur de Market-Making ETF**
Outil Python + React calculant la juste valeur des ETF en temps réel et identifiant les opportunités d'arbitrage création/rachat par rapport aux cotations en direct. Supporte une connexion modulaire pour le flux de marché en direct et la logique d'exécution.

» **Moniteur de Risque de Stratégie**
Dashboard web (Python + Vue.js) pour le backtesting et le suivi du risque de portefeuilles multi-actifs. Simule des mouvements browniens géométriques corrélés et affiche le PnL en direct, la VaR et les Greeks par stratégie.

» **Dashboard Cycle de Vie Produits Structurés**
Dashboard en C# (.NET Core) pour simuler et suivre des produits structurés sur leur cycle de vie, à partir de données historiques et simulées par GBM. Implémente le suivi d'exposition en temps réel, le rééquilibrage de couverture et la visualisation de performance par scénario.