



Diller Djivah

1 an d'expérience professionnelle

✉ diller@hiram-finance.com

☎ + 33 (0)1 42 66 25 25



Domaines de compétences

- **Calcul stochastique** : mouvement brownien, intégrale stochastique, équations différentielles stochastiques.
- **Thèmes en finance mathématiques** : évaluation et couvertures de produits dérivés sur le modèle de Black-Scholes généralisé, modèles à volatilité stochastique, modèles de taux (Vasicek, C.I.R. et H.J.M.)
- **Méthodes numériques** : évaluation d'options européennes, exotiques et américaines par Monte-Carlo, quasi Monte Carlo, arbres et EDP (différences finies).
- **Statistique et économétrie** : analyse en composantes principales et régression linéaire sous SAS, économétrie des modèles linéaires, estimation statistique, tests, analyse de la variance, séries temporelles et filtrage.



Expérience professionnelle

Depuis Novembre 2008 : Consultant à **Hiram Finance en Risk-Management**

Avril – Octobre 2008 : Stage à **Hiram Finance en Risk-Management sur la réplication de portefeuille**

- Présentation des différentes méthodes de réplication de portefeuille traitées dans la littérature financière
- Mise en place d'une bibliographie de référence
- Développement d'un outil avec une nouvelle méthode permettant de calculer et de comparer différentes stratégies de réplication de portefeuille sur des options à barrières



Formation

2007-2008 :

Université Pierre & Marie Curie Paris 6 - Jussieu

Master II Ingénierie Financière et Modèles Aléatoires (IFMA) – **Mention Bien**

www.proba.jussieu.fr/IFMA/

2006-2007 :

Université Pierre & Marie Curie Paris 6 - Jussieu

Master I Mathématiques et Applications :

- Probabilités approfondies
- Approximation des EDP
- Statistique Appliquée

Informatique et systèmes

- Programmation en C++ et VBA.
- Logiciel Microsoft Office
- Latex

Langues : Français, Anglais courant, Gujarati (indien), Espagnol scolaire, Malgache.