



Algorithmes de trading sur les marchés forward

Contexte

Au titre de ses activités industrielles, EDF dispose d'un portefeuille (actifs de production et portefeuille client) exposé aux évolutions des marchés spots et à terme de l'énergie (électricité et gaz). EDF intervient donc sur les marchés afin de valoriser et de couvrir ses actifs.

La couverture de ces actifs nécessite de faire des achats / ventes réguliers sur les marchés forward ; ceux-ci doivent cependant être faits de manière suffisamment discrète pour limiter leur impact sur le marché. En ce sens, les stratégies mises en place sont susceptibles d'être très dépendantes des données de marché et de leur évolution. En pratique, c'est une des tâches affectées aux traders mais elle a le potentiel pour être automatisée facilement.

Descriptif

Le stage se déroulera au sein d'EDF R&D. Il visera à concevoir et à tester des algorithmes de trading sur des marchés énergie forward pour la couverture d'actifs liés à l'énergie. Les tests s'appuieront sur les données de prix disponibles au sein du groupe EDF ou des bourses de l'énergie comme Powernext.

Il s'articulera en plusieurs temps :

- bibliographie et état de l'art des techniques employées pour des problèmes similaires ;
- mise en place d'un cadre de test sur des données historiques ;
- définition d'une méthodologie de comparaison ;
- formulation, implémentation et tests d'algorithmes.

Profil du stagiaire

Niveau d'étude Elève ingénieur ou étudiant en master en année de césure ou en stage de fin d'étude

Domaines de compétences Mathématiques appliquées, analyse de données, programmation

Informatique Une expérience en Python serait un plus

Contact

Arnaud de LATOUR
Tél. : 01 78 19 39 32
arnaud.de-latour@edf.fr

Conditions particulières

Durée proposée 4 à 6 mois

Date de début souhaitée Début entre mars et juin 2018

Localisation Sur le site d'EDF R&D à Saclay

Rémunération Les stages sont rémunérés en fonction du niveau d'étude et de la formation préparée