

Consultant Analyste Quantitatif Risque de Crédit sous SAS
Minimum 03 années d'expérience, Poste basé à Paris

Installé au cœur de Paris, *Ufirst Advisory* est un Cabinet de conseil en forte croissance qui développe une expertise reconnue sur les problématiques liés aux métiers de l'Assurance, du Big Data et de la Finance de Marché.

Disponibilité : Août

Descriptif de la mission : modélisation du risque de crédit

Il s'agira de :

- Effectuer les travaux de mise en place de nouveaux modèles PD/LGD/LGDD sur divers portefeuilles de la banque
- Répondre aux recommandations réglementaires et délivrer les documentations requises
- Réaliser des Backtesting de modèles de risques de crédit PD/LGD/LGDD/EAD et délivrer la documentation requise
- Manipuler et transformer la data
- Développer des modèles quantitatifs et contrôler leur performance en langage SAS
- Comprendre et répondre à des recommandations de la BCE
- Restituer les travaux sous format Word
- Documenter l'ensemble des étapes du process en anglais

Profil recherché :

- *Experts techniques d'au moins 03 années d'expérience sur l'outils SAS*
- Analyse quantitatif avec au moins une première expérience de 03 ans en modélisation du risque de crédit issu d'une formation de type Bac+5 en mathématiques / statistiques
- Maîtrise de l'anglais oral et écrit obligatoire
- Maîtrise des concepts statistiques / probabilistes
- Bon niveau en langage SAS et maîtrise du langage VBA
- Capacité à manipuler les données : extraire, structurer, transformer
- capacité d'analyse et capacité à documenter
- Contact : stephane.happi@ufirst-advisory.com / contact@ufirst-advisory.com

Cabinet de conseil en Assurance & Data Science

UFIRST ADVISORY
66 Avenue des Champs-Élysées
75008, Paris

+ 33 (0)6 84 48 34 71
+ 33 (0)6 65 72 54 73

contact@ufirst-advisory.com
www.ufirst-advisory.com

SIRET : 841 747 512 00017
N° TVA : FR32841747512