

**Expert Modélisation FRTB**  
**Minimum 06 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 : Asap**

**Descriptif de la mission :**

Pour notre client, une banque sur Paris, nous recherchons un expert en modélisation, idéalement avec une forte expérience FRTB. Il s'agit d'une mission longue pour un poste en CDI ou Indépendant

Le candidat doit avoir les compétences suivantes:

- En développement et création de modèle (credit risk ou market risk ou idéalement FRTB..)
- Compétences avancées en programmation en Java, Excel , .net
- Compétences en Python, SAS, R ou autres langages permettant d'évaluer rapidement les caractéristiques des modèles et de comparer les différents modèles possibles.
- Expérience en analyse quantitative
- Est diplômé d'un doctorat dans une matière quantitative (de préférence un diplôme en mathématiques financières) d'un PHD, d'une école d'ingénieur ou d'un diplôme d'actuariat.
- Une expérience professionnelle pertinente de minimum 6 ans
- Une bonne connaissance des marchés de capitaux, des principaux facteurs de risque, des instruments financiers et dérivés
- Une première expérience sur les techniques de modélisation (Idéalement FRTB, ou du risque de marché et/ou de contrepartie et/ou du risque de crédit et des exigences réglementaires.
- Une bonne compréhension des processus stochastiques et des techniques d'évaluation des produits dérivés, connaissance de plusieurs modèles de prix d'actifs sous-jacents et de diverses techniques numériques.

**Autres compétences :**

- Capacité à remettre en question les méthodologies proposées et à proposer des solutions alternatives.
- Compétences en matière de validation : capacité à valoriser de nouvelles idées, qu'elles soient favorables ou critiques, et à examiner les problèmes sous différents points de vue.
- Esprit d'audit pour examiner les méthodologies sous un angle réglementaire.
- Bon niveau en anglais (Avec des compétences rédactionnelles)
- Expérience des techniques et processus de validation de modèles.
- Capacité relationnelle afin d'établir de manière proactive des relations avec divers départements de la banque.

**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

**La mission :**

- Consiste à développer des modèles et effectuer des examens indépendants des méthodologies FRTB, et à conseiller la direction sur le niveau de risque de modèle découlant de l'utilisation de ces méthodologies.
- De réévaluer les modèles internes FRTB, et de modifier et adapter les modèles FRTB qui doivent faire l'objet d'examens indépendants.

**Précision sur le poste :**

- Le candidat doit être un spécialiste, un expert capable de développer et d'effectuer des examens qualitatifs et quantitatifs requis, ainsi que, potentiellement, de guider et de gérer les membres de l'équipe affectés aux projets d'examen.
- Le candidat doit avoir une expertise technique suffisante pour répondre à ces exigences et doit avoir un esprit d'audit, en outre, des compétences pour examiner et réexaminer les méthodologies qui sont axées sur la réglementation FRTB.

**Le contexte (général) réglementaire :**

Le règlement européen appelé CRR permet de calculer les exigences de fonds propres pour le risque de marché par l'approche du modèle interne (IMA), et les exigences de fonds propres pour le risque de contrepartie par la méthode du modèle interne (IMM) et la méthode avancée de l'évaluation du risque de contrepartie (A-CVA).

Notre client a développé des méthodes de calcul de Value-at-Risk (VaR), Stressed VaR, Incremental Risk Capital (IRC) et Comprehensive Risk Measure (CRM) pour le calcul des exigences de fonds propres pour le risque de marché.

Il travaille également sur le développement de nouvelles méthodologies de risque de marché pour se conformer à la prochaine révision fondamentale du règlement sur le portefeuille de négociation (FRTB). Votre intervention portera sur cette thématique.

La CRR exige également l'évaluation prudente de tous les instruments qui sont évalués à leur juste valeur à des fins comptables. L'objectif de la CRR est de garantir que l'évaluation des actifs utilisés à des fins réglementaires ne soit pas supérieure à la valeur de réalisation réelle et, dorénavant, la CRR impose le calcul d'un ajustement supplémentaire de l'évaluation (AVA) à déduire des fonds propres.

**Skills :** Model creation ; Credit Mode ; Market Model ; CVA and Others ; Python ; R ; SAS ; VBA-VB.net

**Contact :** [stephane.happi@ufirst-advisory.com](mailto:stephane.happi@ufirst-advisory.com) / [contact@ufirst-advisory.com](mailto: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](mailto:contact@ufirst-advisory.com)  
[www.ufirst-advisory.com](http://www.ufirst-advisory.com)

SIRET : 841 747 512 00017  
N° TVA : FR32841747512