

Consultant en Finance de Marché, Quant Risques de Crédit
Experts techniques avec plus de 06 années d'expérience sur Matlab et R
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 : début Mars 2020

Descriptif de la mission :

Il s'agira de mettre en place les éléments suivants :

- Modélisation du risque de crédit : modèles bâlois, IFRS9 et Stress-tests.
- Travaux de modélisation des PDs PIT forward-looking (IFRS 9)
- Refonte modèle PD nouvelle définition du défaut (Bâle II)
- Développement de marge de conservatisme de la PD
- Définition et suivi de l'Appétit au Risque
- Adéquation du capital (ICAAP) : définition des méthodes et réalisation.
- Contribution au processus budgétaire
- Définition de normes et méthodes transverses pour le management des risques.
- Exercices réglementaires (reporting EBA, TRIM)
- Stress Test EBA 2018
- Backtestings PD / LGD (Bâle II - IFRS9) sur le portefeuille souverains, le secteur public local...
- Gestion de projets
- Industrialisation des Backtests et reporting via R
- *Développement en Matlab et R*

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

Compétences fonctionnelles & techniques

- *Projet capital avec très peu de temps pour monter en compétences et délivrer des résultats.*
- *Experts techniques avec plus de 06 années d'expérience sur les outils R et Matlab.*
- Ecole d'ingé, Maths FI, Finance Quantitative, Informatique Financière, MIAGE
- Connaissance du risque de crédit et de la réglementation Bâloise
- Fortes compétences en R, Matlab, SQL, VBA, SAS
- Outils de modélisation de données et de gestion de tests
- Anglais (écrit et oral)

Contacts : 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