

Fiche de poste

La Direction des Risques et du Contrôle interne recherche un/ une analyste au sein de l'équipe Modélisation, Validation de modèles et Stress testing

~~de 6 mois~~

Le poste se situe au sein de la Direction des Risques et du Contrôle Interne (DRCI).

La Direction des Risques et du Contrôle Interne (DRCI) pilote le dispositif de contrôle interne et de maîtrise des risques du Groupe CDC. Elle veille à sa cohérence et à son efficacité.

Au titre de sa fonction d'animation, de coordination et de supervision de la « fonction de gestion des risques », elle assure un suivi des risques du Groupe adapté à l'environnement économique, financier et réglementaire, qui contribue au dispositif de pilotage global.

Elle rend compte à la Commission de Surveillance, dans un rapport semestriel sur les risques, de l'ensemble des risques liés aux activités du Groupe. Elle coordonne également le comité des risques de l'Etablissement public présidé par le Directeur général.

La direction compte aujourd'hui près de 90 collaborateurs et anime un réseau d'environ 100 personnes.

La DRCI est organisée en cinq départements :

- Les Risques financiers : marché, crédit, engagements,
- Le Contrôle permanent et la conformité qui comprend les risques opérationnels, les contrôles de 2^{ème} niveau, la déontologie, la lutte contre le blanchiment de capitaux et le financement du terrorisme (LCB_FT), la relation institutionnelle avec Tracfin, le plan de continuité des activités,
- La Production prudentielle et modèles : production réglementaire, modélisation et validation des modèles,
- Le Reporting risques Groupe, la veille et normes prudentielles,
- La Sécurité des systèmes d'information

Rattachement et Mission

Vous exercerez les fonctions d'analyste modélisation au sein du Département Production prudentielle et modèles, dans le Services Modélisation et validation des modèles (constitué de 4 analystes et d'une responsable).

Vous avez pour mission, dans le cadre de l'application de modélisations avancées dans les domaines des risques ALM et de marché, de réaliser les travaux suivants, portant sur deux bilans sur lesquels l'équipe intervient :

- ❖ Alimentation, contrôle et exploitation de la maquette de simulation de bilan à 5 ans (projection de VAN, fonds propres et résultat), avec l'analyste en charge du développement de l'outil : alimentation des données, rédaction du mode opératoire et de la présentation de l'algorithme, contrôles de cohérence des résultats, analyse



des résultats, participation aux développements de l'outil. Réalisation d'études de sensibilité.

- ❖ Mise en œuvre d'évolutions de modélisation portant sur une VaR Monte-Carlo, avec l'analyste en charge du développement de l'outil : ajustement de lois de probabilité non normales pour les actions d'un portefeuille ; rédaction du mode opératoire et de la présentation de l'algorithme. Réalisation d'études de sensibilité.
- ❖ Participation aux travaux sur les autres outils développés par l'équipe en fonction des besoins et disponibilités.

Profil

Sur le plan des connaissances et des compétences techniques : formation de type grande école d'ingénieur (option finance/économie) ou Master 2 en mathématiques et statistiques (assorti d'une formation en finance/économie)

Le candidat doit avoir une bonne compréhension des mécanismes et modèles sous-jacents à ses connaissances et savoir-faire techniques.

Compte-tenu du large champ d'intervention : 2 bilans pour l'analyse ALM, plusieurs indicateurs sur lesquels intervenir, il faut que le candidat :

- ⇒ fasse preuve de rigueur dans les travaux quantitatifs réalisés ainsi que dans sa rédaction de documents ;
- ⇒ aime avoir un large champs d'intervention ;
- ⇒ ait un goût pour les analyses exploratoires et pour les travaux en équipe.