

Poste et missions

Rattaché(e) au Responsable DPMS Pricing, vous travaillerez au sein d'une équipe de 6 personnes avec pour mission de contribuer par vos actions :

- aux processus d'investissement du Front Office en délivrant des Market Data fiables et exhaustifs ;
- au processus de valorisation unitaire des actifs de sorte à permettre le calcul des valeurs liquidatives ;
- à la qualité des données nécessaires aux dispositifs de surveillance des Risques et de Reporting.

Ce poste est une réelle opportunité pour développer vos connaissances en Pricing.

Vos activités principales sont les suivantes :

❖ **Valoriser les instruments financiers :**

- Vous assurez la fourniture ou le calcul quotidien de la valorisation unitaire des instruments financiers (prix, rendement, greeks...) sur tout type d'instruments : Listé / Complexes / OTC ;
- Vous contribuez à la maîtrise des risques en opérant les contrôles qualité nécessaires à la fiabilité des données ;
- Vous répondez aux sollicitations de nos clients internes (Risques, Gestions, Middle Office...) et externes (dépositaires, valorisateurs, commissaires aux comptes ...), en menant des analyses poussées et pertinentes sur les données ou sur la chaîne d'alimentation ;

❖ **Concevoir et adapter les outils associés aux prestations relatives à la valorisation :**

- Vous concevez et contribuez à faire évoluer les outils de pricing et les prestations de valorisation de l'équipe dans le cadre d'une démarche proactive, d'excellence et de satisfaction client ;
- Vous participez à la rédaction des cahiers des charges à destination de la Maintenance Référentielle (expression de besoins, tests, recette...).

❖ **Maîtriser les modèles de pricing :**

- Vous prenez en main les outils de valorisation existants. Pour cela, vous développez votre compréhension des modèles et de la qualité des inputs de marché disponibles ;
- Vous participerez aux contrôles de valorisation de l'ensemble des contrats financiers complexes et OTC, en produisant une évaluation précise et indépendante de celle des contreparties ou des providers ;

Dans un 2nd temps :

- Vous collaborerez à la mise en œuvre de solutions de valorisation au prix de marché ou à l'aide de modèles ;
- Vous aiderez à faire évoluer les modèles de pricing et à les mettre en œuvre, en partenariat avec les différentes Gestions et la Direction des Risques ;
- Vous pourrez intervenir sur des travaux liés aux nouvelles technologies telle que l'Intelligence Artificielle.

Profil et compétences requises

- De formation supérieure Bac + 5 universitaire ou écoles avec spécialisation en finance de marché ou mathématiques financières, vous justifiez idéalement d'une première expérience en finance. Une expérience du métier de la Gestion d'Actifs serait un atout ;
- Vous êtes à l'aise avec les instruments financiers et les techniques de valorisation;
- Vous faites preuve de rigueur, de curiosité, de réactivité et aimez travailler dans un esprit d'équipe et de collaboration ;
- Vous êtes orientés client et avez une bonne expression écrite et orale. Un bon niveau d'anglais est requis ;
- Maîtrise des langages de programmation (Excel/ VBA, SQL...) ;
- La connaissance de providers de données (Bloomberg ...) ou d'outils de pricing est un plus.