

### **Position 1 - Quantitative Analyst Cross-Asset Model Validation – Paris**

Au sein du département Market & Counterparty Risks, de l'équipe Market Risk Analytics, le/la candidat(e) aura pour mission la validation des modèles et produits présentés par les équipes du Front Office, plus particulièrement des modèles pour les produits taux et cross-asset. Il/Elle évaluera la pertinence et la robustesse de ces modèles et les comparera aux modèles implémentés dans les librairies de MRA dont le développement fait partie de ses missions. En fonction des résultats de cette analyse, il/elle déterminera le domaine de validité du modèle et les réserves pour risque modèle associées. Le/La candidat(e) aura également un rôle d'expert(e) quantitatif/quantitative au sein du département d'analyse quantitative des modèles et produits taux et cross-asset (taux/equity/FX/crédit).

#### **Missions principales**

- Analyse et tests des modèles et produits proposés par le Front Office, de leurs comportements et risques.
- Implémentation dans la librairie C++ de MRA soit du modèle proposé par le FO, soit des modèles alternatifs.
- Estimation des paramètres non observables et définition des réserves associées.
- Analyse du risque modèle et définition des réserves modèle associées.

#### **Compétences requises**

- Connaissances approfondies en mathématiques financières et modèles de pricing, idéalement pour les produits de taux.
- Compétence et première expérience en programmation C++.
- Compréhension des risques des produits taux, equity et FX courants.
- Bonne capacité à communiquer à l'oral et à l'écrit, notamment en anglais, et capacité à expliquer des sujets techniques complexes.
- Curiosité intellectuelle et esprit critique.
- Capacité à travailler en équipe et avec des personnes de formations diverses.

Langue de travail : français, anglais.

**To postulate please send your resume to M. PIOT Olivier [olivier.piot@ca-cib.com](mailto:olivier.piot@ca-cib.com) and state whether you postulate to position 1, position 2 or both positions.**

## **Position 2 - Quantitative Analyst XVA Model Validation – Paris**

### **Contexte**

Au sein du Market & Counterparty Risks, au sein de l'équipe Market Risk Analytics, le/la candidat(e) aura pour mission la validation des modèles de pricing des produits présentés par les équipes du Front Office, plus particulièrement des modèles pour le Desk XVA (CVA, FVA, IMVA,...). Il/Elle évaluera la pertinence et la robustesse de ces modèles et les comparera aux modèles/implémentations alternatifs implémentés dans les bibliothèques indépendantes du FO (Bibliothèque MRA dont le développement fait partie de ses missions...). En fonction des résultats de cette analyse, il/elle déterminera le domaine de validité du modèle et participera à l'élaboration des réserves pour risque modèle associées. Le/La candidat(e) aura également un rôle d'expert(e) quantitatif au sein du Département des Risques de Marché.

### **Missions principales**

- Analyse et tests des modèles et produits proposés par le Front Office, de leurs comportements et risques.
- Implémentation dans la bibliothèque de l'équipe MRA (C++) du modèle proposé par le FO pour tester l'implémentation, et de modèles alternatifs pour analyser le risque modèle.
- Evaluation de la calibration des modèles de pricing, de l'estimation des paramètres non observables et définition des réserves associées.
- Analyse du risque modèle et définition des réserves modèle.

### **Missions secondaires**

Support quantitatif des autres équipes de MCR :

- Support quantitatif en cas de problèmes de production (P&L, Grecques, VaR, stress tests) liés au modèle de pricing, proposition et mise en œuvre de solutions.
- Aide au développement d'outils (Excel, VBA, C++) pour le calcul des ajustements/réserves.
- Formation interne sur les aspects quantitatifs des modèles de pricing et produits dérivés.

### **Compétences requises**

- Connaissances approfondies en mathématiques financières et modèles de pricing, notamment pour les produits de taux.
- Compétence et première expérience en programmation C++.
- Compréhension des risques des produits dérivés de taux, equity, FX et Credit.
- Bonne capacité à communiquer à l'oral et à l'écrit, notamment en anglais, et capacité à expliquer des sujets techniques complexes de manière simple.
- Curiosité intellectuelle et esprit critique.
- Capacité à travailler en équipe et avec des personnes de formations diverses.

### **Formation requise**

- Grande école d'ingénieurs / Doctorat ou Master 2 avec spécialisation en mathématiques financières.
- Première expérience en finance de marché appréciée au moins dans le cadre d'un stage de fin d'études.

**Compétences transverses du candidat**

Compétence	Forte	Assez forte	Moyenne	Pas importante
Capacité à communiquer avec aisance et clarté		X		
Esprit d'analyse et de synthèse	X			
Rigueur et sens de l'organisation	X			
Sens du résultat et des priorités	X			
Autonomie		X		
Relationnel/Commercial		X		
Capacité à coopérer/Transversalité	X			

Langue de travail : français, anglais.

To postulate please send your resume to M. PIOT Olivier [olivier.piot@ca-cib.com](mailto:olivier.piot@ca-cib.com) and state whether you postulate to position 1, position 2 or both positions.