

CDI en conseil – 3 années d'expérience:
Analyste PnL & Risques [excellente maîtrise de VBA et SQL]
Poste basé à Paris, début ASAP

Cabinet de Conseil en forte croissance qui développe une expertise reconnue sur les problématiques Risques et P&L en Finance de Marché, nous sommes à la recherche d'un consultant pour un poste en CDI sur une mission au sein de l'entité Capital Markets d'une grande banque de la place Parisienne.

Descriptif missions/ activités principales :

Production :

- ✓ Calcul et analyse du P&L Banking book et Trading book (P&L Eco)
- ✓ Calcul de la VaR
- ✓ Backtesting de la VaR (P&L hypothétique et P&L Réel)
- ✓ Stress Test trimestriel
- ✓ Gestion des écarts P&L Eco / Compta
- ✓ Contrôle et validation de la configuration de pricing utilisés pour le P&L officiel
- ✓ Analyse des paramètres standards permettant de valoriser les books
- ✓ Maintien, revue et documentation de la cartographie des données du marché et la cartographie des configurations de pricing.
- ✓ Suivi quotidien Collateral et analyse des variations
- ✓ Process de valorisation

Projet :

- ✓ Automatisation des processus manuels basés sur des feuilles Excel / VBA, SQL et ACCESS
- ✓ Automatisation et / ou amélioration de nos systèmes en interface avec l'IT
- ✓ Mise en œuvre de nouveaux process où la responsabilité est en cours de transfert depuis une autre équipe
- ✓ Identifier et recommander des aménagements de méthodologies de « price testing » conjointement avec l'entité « Market Risk »
- ✓ Mise en œuvre de nouveaux contrôles / process résultant d'une recommandation du régulateur
- ✓ Participation à l'amélioration des processus / méthodologies actuels

Compétences :

- ✓ Excellente maîtrise de la programmation Excel, SQL, VBA, Access et C++
- ✓ Bonnes connaissances des risques et méthodes de valorisations des produits dérivés (EQD)
- ✓ Bon niveau d'anglais
- ✓ Aptitude à communiquer ses résultats de façon simple et précise
- ✓ Sens de l'autonomie, goût pour le travail en équipe et force de proposition

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

Profil :

Formation supérieur Bac+5 (Grande école d'ingénieur) Maths Fi, Finance Quantitative, Modélisation Financière, Statistique, **3 années d'expérience au sein d'un environnement similaire (Risques et ou P&L).**

Informations complémentaires :

- ✓ Poste à pouvoir en CDI
- ✓ Date de début souhaitée : septembre 2019
- ✓ **Contact :** stephane.happi@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