

Projet EMIR et EBA Stress Test

Cabinet de Conseil en forte croissance, nous sommes à la recherche d'un consultant pour un poste en CDI sur une mission au sein d'une grande banque de la place Parisienne. Au sein de l'entité Capital Markets, vous participerez à la mise en place :

- D'un dispositif de Stress Testing solide en vue d'anticiper l'exercice de Stress Test réglementaires pour l'année 2020.
- D'un cadre et d'une gouvernance pour les Stress Tests internes.

Les missions attribuées seront les suivantes :

- ✓ Revue du draft méthodologique des STT 2020 et rédaction d'un plan d'action
- ✓ Mise en place d'une gouvernance sur les STT
- ✓ Identification des métriques, des scénarii, « des cores principes » et des risk factor
- ✓ Méthodologie de reverse STT
- ✓ Mise en place d'un outil de STT interne
- ✓ Appui méthodologique à l'équipe sur les problématiques de capital planning
- ✓ D'autres missions liées aux projets EMIR seront étudiées :
 - Identifier et recommander des aménagements de méthodologies
 - 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 **SQL, VBA**, C++ et éventuellement Python
- ✓ Bonnes connaissances des risques et méthodes de STT
- ✓ 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

Profil :

Formation supérieur Bac+5 (Grande école d'ingénieur) Maths Fi, Finance Quantitative, Modélisation Financière, Statistique, **06 années d'expérience au sein d'un environnement Risques**

Informations complémentaires :

- ✓ Date démarrage : Septembre 2019
- ✓ **Contact:** 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 : FR32 841747512