

Vous interviendrez notamment sur :

- Des projets de transformation liés à des évolutions réglementaires (IRB Repair, FRTB, SA CCR, Transition IBOR...), ou à de problématiques d'optimisation de processus
- Des projets d'apport d'expertise auprès des directions risques, finance et métier des principaux acteurs de la place
- Des projets d'assistance au développement et à la validation des modèles (modèles de pricing de dérivés, de xVAs, de risque de marché, de crédit, de contrepartie)
- Des projets de transformation liés à l'intégration des techniques d'innovation (Machine Learning, etc.) dans les modèles traditionnels
- Des projets de mise en œuvre de dispositifs relatifs à la gestion du risque de modèle ou de nouveaux risques (risque climatique...)
- Des projets d'assistance aux autres métiers du cabinet pouvant requérir une expertise quantitative (Audit, Transactions, Compliance...)

De manière plus précise, les différents experts interviennent sur les sujets suivants :

Quant Marché :

- Analyses quantitatives de portefeuilles d'instruments complexes,
- Pricing de produits exotiques,
- Définition de méthodologies de valorisation cibles,
- Validation et audit de modèles de valorisation,
- Modélisation des risques de marché, de contrepartie dans le cadre des nouvelles exigences réglementaires (FRTB, SA-CCR, Bâle 4) ou des attentes du superviseur (PVA, etc.),
- Revue critique des méthodologies utilisées dans le cadre de calculs réglementaires (IMA, VaR, ES, IMM, CVA ...) ou comptables (réserves de liquidité, de modèles, etc.),