

Christopher FRAYSSE

Montpellier, France | ✉ christopherfraysse34@gmail.com | 📞 +33 6 43 03 62 25

Présentation

Étudiant en **Master 2 Analyse des risques Bancaire** et futur étudiant du Master Spécialisé **Expert en banque et Ingénierie financière** à TBS Education à partir de la rentrée 2025. Je suis à la recherche d'une alternance de 12 mois dans le domaine du risque ou des derivatives.

🎓 Diplômes

Master spécialisé Expert en Banque et Ingénierie Financière – TBS Education, Paris *A partir d'Octobre 2025*

- Mathématiques appliquées à la finance, Risque de marché, Calcul Stochastique, Derivatives markets and products

Master Monnaie-Banque-Finance-Assurance – Faculté d'économie, Montpellier *Depuis Septembre 2023*

- Spécialité Analyse des Risques Bancaires (2nde année).
- Calcul stochastique, a Analyse des séries temporelles, Économétrie, Gestion de portefeuille, Risque crédit,

Licence d'économie – Faculté d'économie, Montpellier *Mai 2023*

- Parcours Analyse économique et économétrie : statistiques, économétrie, optimisation.

👛 Expériences professionnelles

Stagiaire – Contrôle permanent (LoD 1) – BGL BNP Paribas, Luxembourg *En cours*

- **Contrôles & Analyse d'écarts** : Définition, déploiement et exécution de contrôles LoD1 ; identification et première qualification des anomalies détectées.
- **Standardisation des contrôles** : conception d'un toolkit Excel / VBA pour uniformiser les vérifications et documenter les procédures.
- **Automatisation des échantillons** : rationalisation du traitement via macros Excel, réduisant la charge manuelle et le risque d'erreur humaine.

Assistant – SCI familiale – Montpellier *En cours*

- **Suivi de trésorerie** : modélisation mensuelle des cash-flows et création d'un tableau de bord de liquidité.
- **Analyse rentabilité / risque** : calcul TRI, seuil de rentabilité et évaluation du risque de défaut des locataires.

🌟 Certifications

FRM Part I – Candidat (examen août 2025, GARP)

Financial Risk and Valuation Modeling – Corporate Finance Institute (CFI) (En cours, finalisation Mai 2025)

⚙️ Compétences

- **Méthodes risque & finance** : VaR / ES, Monte-Carlo, modèles GARCH / EGARCH, calibration Heston & Vasicek, modèle logit/probit.
- **Programmation** : Python (option pricing, backtesting), VBA (automatisation, option pricing, gestion de portefeuille), R (Risk modeling), Excel (Lambda, Let), SAS (Traitement d'une base de donnée)
- **Langues** : Français (natif), Anglais (B2).

💡 Projets académiques

Pricing d'options Nvidia & volatilité implicite en Python

- Traçage du smirk de volatilité et calibration des modèles Heston, Black-Scholes et binomiaux à l'aide d'un code python dev from scratch.

Impact des crises sur la prévision du cours Danone (2001–2024)

- Développement et comparaison de modèles Box-Jenkins vs prévisions classiques pour prévoir les rendements.

👥 Savoir-être

Esprit d'équipe · Dynamique · Autonomie · Rigueur · Sens de la synthèse

... Autres

- Ancien membre Force Occitanie (haltérophilie) ; compétitions force athlétique (2019–2020) et cyclisme (2011–2018).
- Centres d'intérêt : cuisine, lecture de vulgarisation économique, boursicotage.