

Sophia HERRERO, CFA

Paris, France | [LinkedIn](#) | +33618062158 | sophia.herrero@ipag.fr

EXPERIENCE PROFESSIONNELLE

Société Générale, CIB

Paris, France

Référente Risque de Crédit

Jan. 2023 – Aujourd'hui

- Réalisation d'analyses de crédit sur des financements structurés (Repo, prêt/emprunt de titres), en évaluant l'exposition et la solidité financière des contreparties.
- Quantification de l'impact des litiges liés aux appels de marge sur l'EAD et le RWA.
- Élaboration d'analyses stratégiques à destination de la direction et d'équipes transverses.
- Contribution à l'élaboration de politiques de risque de crédit en ligne avec les évolutions réglementaires.

Analyste Collatéral

Sept. 2020 – Dec. 2022

- Périmètre couvert : ETF synthétiques, secured notes, Repo, TRS, prêt/emprunt de titres.
- Supervision de stratégies d'optimisation du collatéral (Repos, ETF, TRS) pour améliorer l'efficacité du bilan.
- Amélioration des processus en réduisant les délais de rapprochement et réduire le risque opérationnel.
- Conception et suivi de KPIs pour piloter la production quotidienne et améliorer la gestion des risques.

Amundi Asset Management

Paris, France

Junior Portfolio Manager (Apprentissage)

Sept. 2019 – Août. 2020

- Gestion de portefeuilles obligataires, optimisation de la liquidité et allocation des excédents de trésorerie via des fonds monétaires.
- Rédaction de rapports réguliers pour les clients institutionnels et participation aux revues de performance.
- Développement d'outils VBA pour automatiser le traitement et le reporting des données.

HedgeGuard Financial Software

Paris, France

Product Specialist (Stage)

Fev. 2019 – Juil. 2019

- Implémentation de solutions de gestion de portefeuille pour hedge funds et fonds crypto.
- Onboarding des clients et validation des valeurs liquidatives avec les dépositaires et auditeurs.
- Collaboration avec les développeurs et utilisateurs pour adapter les fonctionnalités aux besoins clients.
- Suivi de la cohérence des indicateurs de performance et de risque (VaR, Benchmark, Exposition...).

EDUCATION

CFA Institute

Paris, France

Chartered Financial Analyst (CFA) Level III

Août 2024

Chartered Financial Analyst (CFA) Level II

Mai 2023

Chartered Financial Analyst (CFA) Level I

Nov. 2022

IPAG Business School

Paris, France

M.Sc. in Finance & Markets

2020

- Major de promotion, GPA of 17,14/20

COMPETENCES & LANGUES

Consulting & Analytique : Résolution de problèmes, communication client, optimisation des processus métiers

Techniques : Excel, PowerPoint, VBA, Bloomberg, SQL (SSMS)

Langues : Français (natif) | Anglais (courant) | Espagnol (avancé) | Portugais (débutant)