

# Sophia HERRERO, CFA

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

## EXPERIENCE PROFESSIONNELLE

### Société Générale, CIB

Référente Risque de Crédit

Paris, France

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

Août 2024

Chartered Financial Analyst (CFA) Level III

Mai 2023

Chartered Financial Analyst (CFA) Level II

Nov. 2022

Chartered Financial Analyst (CFA) Level I

### IPAG Business School

Paris, France

2020

M.Sc. in Finance & Markets

- 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)