

## Offre de poste - Adjoints de direction session scientifique Promotion 2018

### Siège

|                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Intitulé du poste</b>                 | Analyste quantitatif des risques financiers                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>DG / direction / service concerné</b> | DGSO/DRCO/SRMC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>Activité</b>                          | <p>L'analyste quantitatif intègre le service avec pour mission de contribuer à la conception, aux développements et à la mise en œuvre opérationnelle d'outils quantitatifs de mesure et de reporting des risques de marché et de crédit et des performances des opérations de marché</p> <p>Les outils quantitatifs seront développés en prenant appui sur les modèles financiers qui s'articulent sur 1) les modèles de risques de marché (taux de change, taux d'intérêt, spread de crédit, commodities et actions) et 2) les modèles de risques de crédit (défaut, transitions).</p> <p>Ces outils quantitatifs seront conçus et mis en œuvre au sein d'une plateforme informatique « LABODRO » propriété exclusive de la Banque de France. En conséquence, la dimension informatique s'avère très importante avec de nombreux développements informatiques conduits dans le cadre très opérationnel du « LABODRO ».</p> <p>Une mission type s'articule autour des étapes suivantes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Contribuer à l'implémentation informatique de modèles quantitatifs de risque : la programmation se fera sous l'un des langages mentionnés ci-dessus avec l'aide des membres du pôle qui permettront un apprentissage rapide de ces langages (Python ;SQL ;R)</li> <li>• Automatiser l'alimentation des données de marché [source Bloomberg/Reuter], des positions et du reporting</li> <li>• Réaliser des jeux de tests sur les calculs réalisés</li> <li>• Suivre l'évolution de l'outil LABODRO</li> </ul> |
| <b>Compétences requises</b>              | <p>1) Maîtrise des outils mathématiques permettant l'analyse des principaux instruments financiers,</p> <p>2) Maîtrise des outils d'analyse statistique de données et de modélisation probabiliste</p> <p>3) Bonne aisance rédactionnelle</p> <p>4) Bonnes connaissances de certains langages informatiques (maîtrise d'au moins un langage parmi Python, SQL, R, Matlab, VBA). Connaissances en architecture logicielle très utiles. Des compétences en développement et/ou Base de données un plus.</p> <p>Une bonne maîtrise de l'anglais dans un contexte professionnel – oral et écrit – est essentielle.</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |