



## ANALYSTE QUANTITATIF MARCHES

### SA MISSION

- Au sein de l'équipe Risques de marchés de la direction des Risques, l'analyste quantitatif contribue à l'ensemble des travaux de validation des modèles/pricers pour un périmètre donné (actions/commodities, fixed income, etc...)
- L'Analyste quantitatif valide des modèles de pricing et de risk management.
- Il/Elle audite des modèles dans les systèmes, quantifie et mesure les risques de modèle.
- Il/Elle participe à la définition des méthodologies de calcul de risques de marchés : nouveaux indicateurs de risques, calibrage de stress tests, estimation de paramètres, etc. et ce en collaboration avec les risk controleurs du pôle. Il/Elle participe aux calculs des refactions au titre du risque de modèle.
- Il/Elle documente les processus et rédige les procédures liées à l'activité de validation de modèle.
- Il/Elle participe aux travaux de recherche et de veille technologique.