



Apprenti.e au département Gestion du Bilan

- Contribuer à la mise à jour annuelles des paramètres des modèles (indices de projections, lois statistiques et paramètres de ces dernières) nécessaire au calcul des modèles de VaR ;
- Définir / modifier les méthodologies internes de suivi et de mesure des risques, en lien avec les autres membres du service, les autres équipes de la Direction des Finances et en interaction régulière avec la Direction des risques et les métiers ;
- Participer à la réalisation d'études d'impact des nouveaux indicateurs de risque du modèle, en tenant compte des recommandations de la Direction des risques, de la Direction de l'audit et de l'ACPR sur le modèle prudentiel de solvabilité ;

PROFIL RECHERCHÉ

La CDC fonde le recrutement sur les compétences en excluant tout critère de discrimination. Tous nos postes sont ouverts aux personnes en situation de handicap.

- Formation en Statistiques et/ou en Mathématique Financière.
- Intérêt pour la finance, les mathématiques financières, l'économétrie et la modélisation (calculs stochastiques, analyse quantitative, optimisation de portefeuilles ...).
- Capacités de programmation et d'implémentation de calculs économétriques, notamment sous R et VBA.
- Rigueur intellectuelle, autonomie, esprit de synthèse, capacités d'expression écrite et orale et qualités relationnelles (engagement, curiosité, ouverture d'esprit, et capacité à travailler au sein de groupes pluridisciplinaires).