

Management des risques

PROJET DE REVUE MÉTHODOLOGIQUE DU CALCUL DU WRONG-WAY RISK D'UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Étude de faisabilité et benchmark des solutions potentielles
- Calibration et implémentation des modèles de Hull & White et Rosen & Saunders pour le calcul de CVA et WWR
- Étude et comparaison de l'efficacité entre approche Cross-Section et l'approche Intersection
- Simulation sous la probabilité risque-neutre de l'exposition des produits dérivés de crédit (en utilisant American Monte-Carlo)

PILOTAGE D'UN PROJET DE REFONTE DU MODÈLE DE VaR POUR LES PRODUITS INFLATION POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- État des lieux, cadrage, planning et chiffrage du projet
- Revue de l'économétrie, de la revalorisation et des modèles de risques pour les swaps et options inflation
- Amélioration de la prise en compte du risque inflation en VaR : mise en place d'une économétrie SABR pour les volatilités des indices inflation et revue intégrale des pricers de dérivés inflation

INDUSTRIALISATION DES MODÈLES D'ÉCONOMÉTRIE SERVANT AU CALCUL DE LA VaR, EEPE, IRC POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Calibration des paramètres de modèles statistiques et stochastiques sur toutes classes d'actifs
- Suivi de la production et diffusion des facteurs de risque servant à la production des indicateurs
- Back-tests et stress-tests des données de marchés historiques, études d'impact des nouveaux modèles sur la VaR, EEPE, IRC