

Marchés financiers

PILOTAGE D'UN PROJET DE REFONTE DU SCHÉMA DIRECTEUR FRONT OFFICE/RISQUE POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Inventaire des processus métiers existants : interviews, analyse de la documentation, définition des cibles
- Conception des évolutions de l'architecture IT pour implémenter ces changements
- Cadrage des programmes de transformation, management des équipes, mise en place de méthodologies projet et run
- Alignement à l'international, alignement avec les autres lignes métiers de la BFI

ANALYSE ET DÉVELOPPEMENTS QUANTITATIFS AU SEIN D'UNE ÉQUIPE DE GESTION EN CHARGE D'UN PÉRIMÈTRE EQUITY D'UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Étude et amélioration de la stratégie Low Volatility ainsi que d'une stratégie multifactorielle (ERA : Equal Risk Allocation).
- Réalisation de backtests pour les différentes stratégies étudiées et rebalancements de portefeuilles
- Suivi des indicateurs de risques liés aux stratégies : VaR, Tracking Error, CVaR

VALORISATION DES PRODUITS STRUCTURÉS ACTIONS ET MATIÈRES PREMIÈRES DANS LE CADRE DU RACHAT D'UN PORTEFEUILLE PAR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Étude des différents produits structurés par analyse des termsheets : autocallable, callvscall, autopilot
- Structuration et pricing d'Indices Custom de produits structurés et de dérivés exotiques
- Booking des produits dans les portefeuilles de BNPP et automatisation des tâches répétitives via des développements customs