

Recruteur	EY
Adresse	1 Place des Saisons 1 Place des Saisons
Code postal	92400
Ville	Courbevoie Courbevoie
Référence	1518272
Titre de l'offre	Analyste quantitatif junior - Quant Crédit H/F
Description de la mission	Dans le cadre de son développement pour le secteur des Services Financiers, EY recherche des Consultants Débutants, ayant eu une première expérience dans ce domaine.

Au sein du département FSO (Financial Services Office), 1 200 collaborateurs en France combinent leurs expertises métiers et fonctionnelles, afin de répondre efficacement aux besoins de nos clients en gestion d'actifs, banque ou assurance. Dans un contexte en perpétuel changement et hautement réglementé, nous apportons ainsi à nos clients des conseils pour les aider à gérer les incertitudes et les opportunités de ce secteur.

Vous rejoindrez l'équipe quantitative sur le poste suivant : analyste quantitatif spécialisé en modélisation pour les activités de crédit (Analystes Quant Crédit)

L'opportunité

L'équipe quantitative est amenée à travailler sur des sujets variés relatifs aux instruments financiers et à la modélisation du risque de marché, de contrepartie ou de crédit, à des projets de transformation, en interaction avec les équipes quantitatives des principaux établissements de la place (Banques, Asset Managers ou Assurances), avec les autres métiers du cabinet EY (Robotics, Data Analytics) et au cœur d'un réseau international.

Les projets menés par l'équipe quantitative sont entre autres :

- Des projets de transformation liés à des évolutions réglementaires (FRTB, SA-CCR, Transition IBOR, IRB Repair...), ou à des problématiques d'optimisation de processus
- Des projets d'apport d'expertise auprès des directions risques, finance et métier des principaux acteurs de la place
- Des projets d'assistance au développement et à la validation des modèles (modèles de pricing de dérivés, de xVAs, de risque de marché, de crédit, de contrepartie)
- Des projets de transformation liés à l'intégration des techniques d'innovation (Machine Learning, etc.) dans les modèles traditionnels
- Des projets de mise en œuvre de dispositifs relatifs à la gestion du risque de modèle ou de nouveaux risques (risque climatique...)
- Des projets d'assistance aux autres métiers du cabinet pouvant requérir une expertise quantitative (Audit, Transactions, Compliance...)

De manière plus précise, les Analystes Quant Crédit interviennent sur les sujets suivants :

- Modélisation du risque de crédit dans le cadre de la remédiation post TRIM, des nouvelles exigences réglementaires (IRB Repair, Bale 4) et des exigences comptables (IFRS 9)
- Validation et audit de ces modèles
- Back testing et stress testing des modèles internes
- Revue critique des méthodologies utilisées dans le cadre de calculs réglementaires (PD, LGD, CCF...), du capital économique ou des provisions comptables (méthode de projection Forward looking, PD lifetime)

Accompagnement dans la mise en place d'une architecture de modèles cohérente, leur interaction, leur adaptation aux nouveaux risques (ex. risque climatique) et l'identification des pistes d'amélioration
Développement de modèles statistiques de détection d'événements de fraude / criminalité financière

Assistance à la mise en place de nouvelles offres alternatives telles que la collecte de données automatisée via l'Open Banking, le développement de l'intelligence artificielle dans la mesure de risques et l'intégration de l'impact du changement

Type de contrat
Télétravail
Description de la société

CDI
Pas de télétravail
EY rassemble aujourd'hui 365 000 associés et collaborateurs à travers le monde dans plus de 150 pays. Grâce à ce réseau, dont le niveau d'intégration et l'ampleur internationale sont gages d'une même excellence partout dans le monde, EY renforce sa position de leader mondial de l'Audit, du Conseil, des Transactions, de la Fiscalité et du Droit. Nous faisons grandir les talents afin, qu'ensemble, ils accompagnent les organisations vers une croissance pérenne. Et notre engagement envers nos équipes commence avec cette promesse : quel que soit votre parcours avec nous, l'expérience EY dure toute une vie.

Une carrière qui vous ressemble en se développant en continu grâce à notre programme de formations : rejoindre EY c'est développer des compétences indispensables pour rester dans la course. En évoluant très rapidement et régulièrement au sein de l'organisation et en ayant également la possibilité après deux ans d'expérience d'évoluer dans une autre ligne de service pour enrichir votre expérience EY.

Les préoccupations des collaborateurs EY en faveur du climat et de l'environnement s'expriment à travers des initiatives concrètes portées par le réseau Ecology : Plus de 1000 formations climats à destinations de nos collaborateurs depuis 2021.

Chez EY nous avons une politique de télétravail innovante : le SmartWorking.

SmartWorking@EY a vocation à donner l'opportunité de naviguer avec souplesse, autonomie et responsabilité au sein d'un réseau de différents espaces que forment le domicile, le site client, le bureau et d'autres lieux.

Ouvert à tous, ce dispositif permet de choisir les modalités de travail les plus appropriées à l'instant T, en fonction du client et de l'équipe, de la mission, du projet et de l'activité en cours.

Son objectif : favoriser l'efficacité et l'atteinte des objectifs en autonomie et encourager plus encore l'excellence, la liberté individuelle et collective, la responsabilité et la confiance réciproque.

Localisation
Code localisation
Pays
Description du profil

Paris
Union Européenne
France
Vous êtes diplômé d'une école d'ingénieurs et/ou d'une formation universitaire avec une spécialisation en calcul stochastique et/ou statistiques.

Vous avez idéalement une expérience de stage et/ou une première expérience professionnelle de minimum 1 an dans un environnement financier (Banque, Assurances, Asset Management).

Doté d'un excellent sens relationnel, vous savez allier le sens de l'analyse et de la synthèse, rigueur et méthode. Curieux, dynamique, responsable et autonome, vous faites preuve d'esprit d'équipe.

Vivez l'expérience EY, Rejoignez-nous !

« Dans le cadre de sa politique Diversité, EY étudie, à compétences égales, toutes candidatures dont celles de personnes en situation de handicap. »