



<https://latribunelibre.com/emploi/analyste-quantitatif-ifrs9-experimente-risque-de-credit-f-h>

Analyste quantitatif IFRS9 expérimenté – Risque de crédit F/H

Description

Au sein du département Risque de crédit, vous intégrez l'équipe notamment en charge de la conception et du suivi des modèles IFRS9 de calcul des provisions saines.

Le modélisateur sera amené à intervenir sur toutes les activités de l'équipe, dont les principales missions sont de :

- Modéliser les paramètres IFRS9 avec un caractère prospectif (vision « forward-looking ») : probabilités de défaut (P.D), pertes en cas de défaut (LGD) et exposition en cas de défaut (EAD) ;
- Concevoir, produire et documenter les méthodologies de backtesting des modèles ;
- Réaliser des études de modélisation ad-hoc : sensibilité des pertes à l'environnement macro-économique,
- Réaliser les études de projections du coût du risque (ICAAP, stress-tests) ;
- Faire évoluer les méthodologies (évolutions réglementaires, demandes des organes de contrôle internes et externes) ;
- Présenter et défendre les différents travaux, en Comités techniques et lors de missions d'audit (internes ou externes) ;
- Contribuer à l'amélioration et à l'automatisation des processus internes.

Qualifications

COMPETENCES RECHERCHÉES

- Expérience en modélisation statistique du risque de crédit, particulièrement sur IFRS9 ;
- Maîtrise des outils Python / R / SAS ;
- aisance dans la manipulation de données volumineuses et complexes ;
- Connaissance des exigences réglementaires relatives au risque de crédit ;
- Compétences analytiques et capacité de vulgarisation ;
- Force de proposition ;
- Capacité à travailler en équipe ;
- Qualité rédactionnelle.

Le modélisateur devra être en mesure de porter ses sujets de bout en bout, du

Organisme employeur

CONFEDERATION NATIONALE
DU CREDIT MUTUEL

Type de poste

Temps plein

Secteur

AUTRES INTERMÉDIATIONS
MONÉTAIRES

Lieu du poste

75117, PARIS 17, PARIS, France

Date de publication

19 septembre 2025 à 09:04

Valide jusqu'au

19.10.2025

développement de modèles jusqu'à la restitution aux organes de contrôles et leur implémentation.

PROFIL RECHERCHE

Issu d'une grande école d'ingénieur ou d'un M2 universitaire spécialisé en mathématiques, statistiques, finance ou économie, vous avez au moins 5 ans d'expérience sur un poste de modélisation en risque de crédit. Une expérience spécifique sur des problématiques forward-looking est indispensable pour ce poste.