

FICHE DE POSTE : Business Analyst XVA

Contexte / Objectifs :

Au sein du pôle Pricing & Analytics de l'IT Global Markets, nous recherchons un Business Analyst expérimenté sur la partie Pre Trade & Pricing Solutions XVA.

L'équipe est en charge de la valorisation et de la production des indicateurs de risque de contrepartie XVA en forte connectivité avec les librairies de pricing implémentés par les ingénieurs quantitatifs XVA. Ces indicateurs sont consommés par le desk de trading XVA ainsi que les équipes d'analystes de risque (de marché, crédit et contrepartie).

L'équipe travaille en collaboration étroite avec le desk de trading XVA mais aussi les équipes d'analystes de risque (de marché, crédit et contrepartie).

Expertises spécifiques :

- **Connaissances des acteurs du marché financiers, de la finance de marchés plus précisément des produits structurés et exotiques (Taux, equity, crédit).**
- **Maîtrise des techniques de pricing : méthode de Monte Carlo, formules fermées telles que Black-Scholes.**
- **Bonne compréhension des environnements de marchés financiers et des pratiques en matière de gestion de position.**
- **Connaissance de la XVA (CVA, FVA, ... et des indicateurs de risques majeurs).**
- **Anglais professionnel (écrit et oral), car l'environnement est international.**

Besoin d'un consultant à la fois à l'aise pour discuter avec le Front office, mais également ayant une appétence technique: investiguer un problème technique avec les développeurs, parser des logs, requêtes SQL.

Doté-e d'une bonne rigueur et d'une grande réactivité, vous avez le sens de la communication, êtes capable d'anticiper et prendre des initiatives et avez l'esprit d'analyse et de synthèse.

Description de la typologie de prestation :

- **Recueil des besoins et Rédaction des spécifications fonctionnelles générales**
- **Priorisation des projets ou lots d'un projet**
- **Suivi des développements avec la Maîtrise d'œuvre**
- **Établissement du cahier de recette et réalisation de la recette**
- **Accompagnement à la mise en production**
- **Formation utilisateurs et Rédaction des procédures et guides utilisateurs**
- **Coordination projet et Reporting**
- **Documentation technique et veille technologique sur les innovations en matière de produits structurés et d'outils de pricing.**

Séniorité : **Entre 6 et 9 ans**