

Le/la spécialiste en contrôle des risques de marchés dans une société de gestion d'actifs identifie, évalue et surveille les risques liés aux fluctuations des marchés financiers. Il/elle s'assure que les portefeuilles d'investissement respectent les limites de risque définies et propose des solutions pour optimiser le rapport rendement/risque.

Missions principales/responsabilités

Identification et évaluation des risques

- Analyser les portefeuilles d'investissement pour détecter les expositions aux risques de marché (taux, actions, devises, etc.)
- Évaluer les impacts des variations de marché sur les portefeuilles grâce à des scénarios de stress test et des modèles de valorisation

Surveillance et reporting

- Contrôler les limites de risque établies par la société ou les régulateurs.
- Produire des rapports réguliers pour la direction, les gérants et les régulateurs sur les niveaux de risque

Compétences requises

Techniques/métier

- Maîtrise des techniques d'évaluation des risques (VaR, backtesting, stress testing)
- Connaissance approfondie des instruments financiers (actions, obligations, dérivés) et des marchés
- Expérience avec des logiciels spécialisés (RiskMetrics, Bloomberg, Python, R, VBA)
- Aisance en anglais

Relationnelles/transversales

- Capacité à expliquer des concepts techniques complexes de manière claire

Formation, diplômes requis et expérience

- Bac +5 en finance, mathématiques appliquées, économie ou école d'ingénieurs
- Certifications comme le FRM ou le CFA
- Expérience de 3 à 5 ans en gestion des risques ou analyse financière

Développement d'outils de gestion des risques

- Concevoir et améliorer des modèles quantitatifs pour mesurer et surveiller les risques
- Implémenter des systèmes de suivi en temps réel des expositions aux marchés

Collaboration

- Travailler en étroite relation avec les gérants de portefeuille pour anticiper et gérer les risques
- Interagir avec les équipes de conformité et d'audit interne pour assurer la cohérence des contrôles

- Esprit collaboratif pour interagir avec les différentes équipes (gestion, conformité, IT)
- Aptitude à gérer des situations critiques avec réactivité

Personnelles

- Rigueur et sens du détail dans l'analyse des données
- Esprit analytique et capacité à anticiper les évolutions de marché
- Résilience face à des environnements de travail sous pression

Évolution professionnelle

- Responsable des risques de marché
- Directeur/Directrice des risques au sein d'une société de gestion
- Consultant/e spécialisé/e en gestion des risques financiers