

Mon Métier de Analyste quantitatif



Analyste quantitatif



VOS ROLES ET VOS ENJEUX

Vous développez et adaptez des modèles mathématiques de simulation et de prévision des risques financiers. Vous analysez les données statistiques, les interprétez et créez de nouveaux modèles analytiques pour aider les opérateurs de marché dans leurs décisions. Vous êtes capable de travailler en étroite collaboration avec les équipes de trading et de gestion des risques. Vos compétences en mathématiques financières, programmation et analyse statistique sont essentielles pour contribuer à l'optimisation des stratégies d'investissement et à la gestion des risques de l'institution.

VOS RESPONSABILITÉS

- Développer des modèles mathématiques complexes pour simuler et prévoir les risques financiers au sein de Crédit Mutuel Alliance Fédérale
- Analyser et interpréter des données statistiques pour aider à la prise de décision des opérateurs de marché
- Concevoir et tester de nouveaux programmes analytiques adaptés aux besoins spécifiques de Crédit Mutuel Alliance Fédérale
- Collaborer étroitement avec les équipes de trading et de gestion des risques pour optimiser les stratégies d'investissement
- Assurer une veille technologique et réglementaire pour maintenir à jour les modèles utilisés
- Présenter des rapports détaillés et des recommandations aux dirigeants de Crédit Mutuel Alliance Fédérale
- Participer à l'amélioration continue des processus d'analyse quantitative au sein de l'organisation
- Former et conseiller les collègues sur l'utilisation et l'interprétation des modèles développés
- Contribuer à l'innovation financière en proposant de nouvelles approches d'analyse quantitative
- Garantir la conformité des modèles avec les réglementations financières en vigueur

Exemples de parcours pour y parvenir : Formation en mathématiques, statistiques ou ingénierie financière. Expérience en programmation et modélisation.

Exemples d'opportunités à partir de ce métier : Pour découvrir les autres métiers, consultez la [Carte des métiers et parcours professionnels](#).





LES COMPÉTENCES		
SAVOIR-FAIRE	SAVOIRS	SAVOIR-ÊTRE
Analyse	Conformité	Être acteur du collectif
Maîtrise de risque	Durabilité	Être centré client
Modélisation	Finance	Être responsable
Qualité	Langues	Faire preuve de flexibilité
Reporting	Modélisation	Savoir communiquer
Travail en équipe	Projet et innovation	
	SI & DATA	
	Stratégie	



SAVOIR-FAIRE	Définitions
Analyse	• Multiplier, décrypter et comparer les informations, garantir la fiabilité des sources et intégrer l'environnement, ses stratégies passées, actuelles et futures • Investiguer le sujet, évaluer la sensibilité des données et mesurer les zones de risques et d'opportunités • Faire preuve d'expertise, d'acuité et de hauteur de vue dans l'évaluation des scénarii • Formaliser les orientations et arbitrages à privilégier, peser leurs impacts court, moyen et long terme, en lien avec la stratégie • Apporter l'éclairage et le conseil nécessaires à la prise de décision
Maîtrise de risque	• Piloter le risque dans le respect du corps de règle, définir et déployer les plans d'actions pour garantir une stratégie optimale de maîtrise du risque • Conseiller, orienter et accompagner les parties prenantes pour affiner les méthodologies de contrôle, d'analyse et de mise en œuvre au service de la prévention des dégradations • Garantir la maîtrise des risques et le respect des normes réglementaires, définir les procédures et sécuriser les équilibres financiers • Modifier le corpus dans le respect des procédures et de la réglementation, animer la documentation sur le terrain et l'utiliser comme un levier d'amélioration et de performance
Modélisation	• Définir le périmètre d'analyse, identifier ses paramètres et comprendre leurs enjeux dans une dynamique court, moyen et long terme • Construire les modèles de calcul et de projection en fonction des données à agréger et adapter la modélisation au volume et à la complexité des données • Formuler les hypothèses, tester leurs sensibilités et leur pertinence et remettre en cause les modèles pour maîtriser les mécanismes d'évolution et leurs impacts • Traduire les scénarios en préconisations en lien avec les stratégies à privilégier, mettre l'information au niveau des parties prenantes concernées et faciliter la prise de décision
Qualité	• Structurer des propositions adaptées et performantes, garantir la qualité des livrables dans le respect de la conformité et des normes en vigueur • S'appuyer sur des indicateurs fiables, veiller au respect de la méthodologie et des procédures de contrôle pour garantir la pertinence des contrôles • Respecter et mettre en pratique la démarche qualité tout au long des étapes du projet ou de l'action menée • Intégrer les évolutions réglementaires des activités de son périmètre et les mettre en application en quotidien
Reporting	• Produire des tableaux de bord pour suivre les niveaux de service, de conformité et de maîtrise des risques • Structurer l'information, présenter et expliquer les résultats et s'assurer de la bonne compréhension par l'ensemble des parties prenantes • Garantir la fiabilité des données transmises, argumenter ses choix avec efficacité et justifier la pertinence des propositions



SAVOIR-FAIRE	Définitions
Travail en équipe	• Interagir dans un environnement pluridisciplinaire, identifier et mobiliser les spécialisations adéquates dans un objectif d'efficacité • S'investir dans la dynamique d'équipe, participer à la qualité des informations transmises et s'engager dans le bon fonctionnement au quotidien • Partager son expérience, transmettre son savoir et contribuer au développement des compétences de l'équipe • Développer et entretenir un réseau interne basé sur la confiance et la qualité de la relation

Analyste quantitatif



Attention : Les détails de la compétence sont donnés à titre indicatif et ne sont pas nécessairement à maîtriser pour la compétence dans le métier de cette fiche. Ils serviront à alimenter les fiches pédagogiques en formation.

SAVOIRS	Compétences	Détails
Conformité	• Conformité déontologie	• Conflits d'intérêts client/salarié • Corruption • Faculté de signalement • Listes de surveillance et d'interdiction • Suivi du personnel sensible
	• Conformité éthique	• Politique interne d'entrée en relation
	• Risques	• Cartographie des risques • Risques de marchés • Risques de taux • Risques opérationnels
Durabilité	• Critères ESG	• Critères de gouvernance • Critères environnementaux • Critères sociaux
	• Mutualisme	• Raison d'être et valeurs • Spécificités du modèle et ses axes d'évolutions • Structure organisationnelle
Finance	• Consolidation	• États financiers consolidés • Intégration fiscale • Obligations légales et réglementaires • Techniques de consolidation
	• Investissements ESG	
	• ISR	• Indicateurs ISR
	• Maths financières	
	• Valorisation d'entreprise	• Analyse financière boursière • Financements spécialisés - syndication • Financements spécialisés et produits structurés • Valorisation d'entreprise
Langues	• Anglais	
Modélisation	• Modélisation informatique	• Développement de modèles informatiques • Modèles de modélisation informatique
	• Modélisation mathématique	• Probabilités • Statistiques

Analyste quantitatif



Attention : Les détails de la compétence sont donnés à titre indicatif et ne sont pas nécessairement à maîtriser pour la compétence dans le métier de cette fiche. Ils serviront à alimenter les fiches pédagogiques en formation.

SAVOIRS	Compétences	Détails
Projet et innovation	• Pilotage de la transformation	• Définition / structuration de projet de transformation • Gestion des parties prenantes • Planification de la transformation • Reporting transformation • Techniques et processus de transformation
SI & DATA	• Data science	• Connaissance des flux et structures de données métier • Data management/pré-processing • Préparation de bases de données ; manipulation/transformation de volumes de données importants • Statistiques avancées et théorie des probabilités
Stratégie	• Stratégie financière	• Politique de gestion • Politique de valorisation d'actifs • Politique d'investissement



SAVOIR ETRE	Définitions
Être acteur du collectif Capacité à s'inscrire et à participer activement à une dynamique collective, à développer une relation de confiance avec les autres personnes de son équipe et fédérer dans un objectif commun	• Je sais travailler et construire avec plusieurs interlocuteurs • J'adhère à un projet de groupe
Être centré client Capacité à mettre le client externe comme interne au centre de notre attention, à être force de proposition pour répondre au mieux à ses besoins et à ses attentes au service de la performance	• Je tiens compte de l'intérêt du client dans mes décisions • J'adapte ma posture en fonction de la personne en face
Être responsable Capacité à utiliser les moyens à disposition pour atteindre ses objectifs, à prendre de la hauteur et à être responsable de ses choix pour améliorer la performance de son activité et avancer dans un esprit de confiance	• Je tiens compte des conséquences de mes choix et les assume • Je sais me remettre en cause et accepter la critique
Faire preuve de flexibilité Capacité à s'adapter rapidement et efficacement à des situations changeantes ou imprévues - Capacité à remettre en question ses propres certitudes et de trouver des solutions créatives à des problèmes complexes	• Je trouve des solutions différentes pour résoudre des problèmes complexes • Je m'adapte facilement à de nouvelles situations de travail • Je suis capable de travailler efficacement avec des personnes ayant des points de vue différents • J'ai conscience d'évoluer dans un environnement changeant et incertain
Savoir communiquer Capacité à écouter et comprendre - Savoir appréhender les différentes techniques de communication (écrit, oral, non-verbal), adapter sa communication et faire preuve de pédagogie	• Je sais faire preuve d'empathie • Je m'adapte à mon interlocuteur • Je choisis le canal de communication pertinent