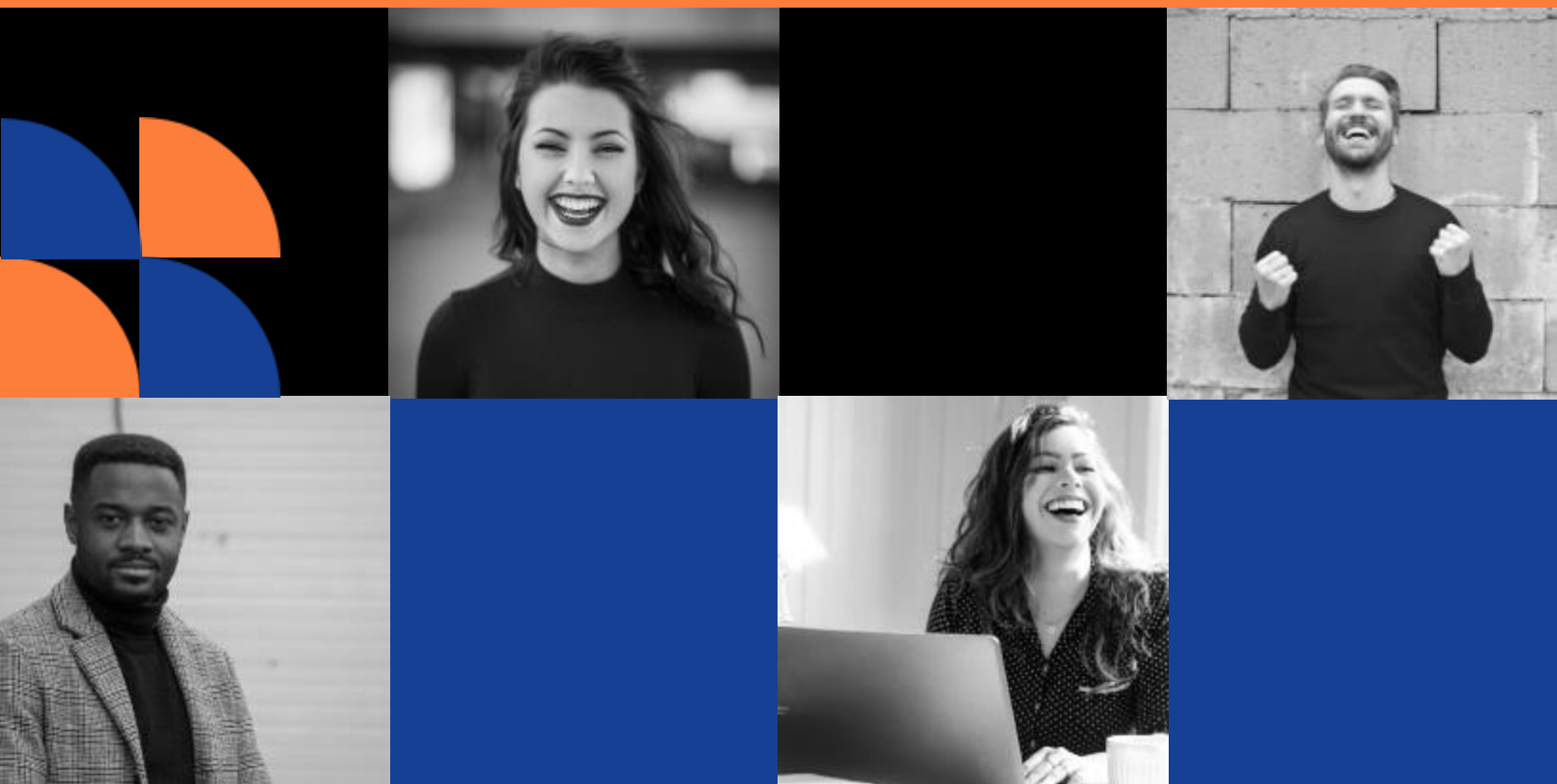


# Mon Métier de Manager des Risques Salle de Marchés



# Manager des Risques Salle de Marchés



## **VOS ROLES ET VOS ENJEUX**

Garde-fou des activités de marché auprès du Groupe et/ou des sociétés de gestion externes, vous déclinez la politique de gestion des risques auprès des preneurs de risques. Au sein de l'activité Dépositaires, vous gérez, pilotez et contrôlez les risques pris par la Salle de Marchés, ainsi que les risques sur les sociétés de gestion. Vous définissez, déployez et animez le dispositif de pilotage des risques sur la totalité des risques afférents, et accompagnez les opérateurs de marchés et sociétés de gestion dans une prise de risques maîtrisée, en accord avec la stratégie du Groupe et la réglementation.

Vous encadrez la structure du risque, et suivez sa bonne application. Vous contribuez également à l'évolution de la politique du risque et de sa documentation en interne.

Par vos activités, vous portez la raison d'être et les valeurs du Groupe, vous veillez à leur respect sur les marchés et contribuez ainsi à leur rayonnement interne et externe.

## **VOS RESPONSABILITÉS**

- Suivre, analyser et intégrer l'actualité politique, financière et économique internationale dans la gestion des risques
- Evaluer les risques de marchés et leurs tendances d'évolution et vérifier le respect des limites fixées
- Accompagner les preneurs de risques dans l'optimisation de leurs positions et arbitrages
- Suivre les prises de risques quotidiennes sur les marchés, les contrôler et garantir la conformité des pratiques
- Produire les états et reporting journaliers sur le PNB, les encours de risques et les valorisations, les contrôler et vérifier la cohérence des risques et résultats
- Communiquer et partager auprès des preneurs de risques et du management

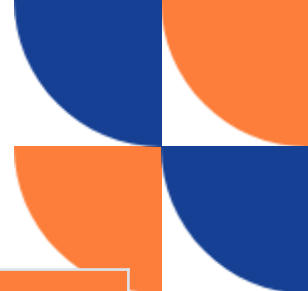
- Faire vivre la documentation, la faire évoluer et l'actualiser pour répondre au mieux aux besoins des marchés et à la stratégie du Groupe
- Analyser les pratiques et comportements des preneurs de risques, identifier les natures de risques et faciliter l'amélioration de leurs pratiques
- Construire les études et analyses nécessaires au service de la Direction Générale, des organes de contrôle et des instances de tutelle
- Développer les systèmes de pilotage et contrôle des risques de marché, identifier les incohérences en matière de saisie des opérations par les opérateurs
- S'engager dans des projets internes et contribuer activement à l'amélioration des outils de gestion et processus de fonctionnement des équipes
- Se former et développer ses compétences pour consolider sa légitimité et son rôle au profit des activités de marchés et de ses parties prenantes

Exemples de parcours pour y parvenir : Expérience réussie en banque privé, voire dans des fonctions d'expertise patrimoniale, + Master II (GP, Finance, Droit, ...)

Exemples d'opportunités à partir de ce métier : réseau Grande-Entreprise, Banque Privé, Filières spécialisée, Management, Support, ...



# Manager des Risques Salle de Marchés



LES COMPÉTENCES		
SAVOIR-FAIRE	SAVOIRS	SAVOIR-ÊTRE
Analyse	Conformité	Apprendre à apprendre
Conseil	Droit	Assertivité
Maîtrise de risque	Durabilité	Etre acteur du collectif
Modélisation	Econometrie	Etre centré client
Reporting	Finance	Etre proactif
	Langues	Etre responsable
	Middle & Back Office	Faire preuve de courage
	Modélisation	Faire preuve de flexibilité
	Projet & Innovation	Faire preuve d'esprit critique
	SI & DATA	Innovation
	Sécurité	Porter nos valeurs
		Savoir communiquer

# Manager des Risques Salle de Marchés



SAVOIR-FAIRE	Définitions
<p><b>Analyse</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Sélectionner et croiser les sources d'informations, intégrer l'hétérogénéité, la durée de vie et la sensibilité des données, et garantir leur pertinence au service de l'analyse</li> <li>• Prendre en compte l'environnement, ses évolutions et enjeux, mener les études et établir le diagnostic adéquat en lien avec les parties prenantes concernées</li> <li>• Porter une approche objective des situations, élaborer les scénarii pertinents et évaluer les risques et leurs impacts avec une approche court moyen et longs termes</li> <li>• Formaliser les conclusions et poser les arbitrages et leurs arguments dans un objectif de performance</li> <li>• Partager les recommandations, associer les parties prenantes et faciliter la prise de décision</li> </ul>
<p><b>Conseil</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Analyser et comprendre le contexte, identifier les besoins des clients internes</li> <li>• Etablir des diagnostics, préconiser des solutions et veiller à leur bonne compréhension</li> <li>• Partager ses connaissances et son expérience, apporter l'éclairage nécessaire pour aider les choix d'orientation et la prise de décision</li> </ul>
<p><b>Maîtrise de risque</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 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</li> <li>• 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</li> <li>• Garantir la maîtrise des risques et le respect des normes réglementaires, définir les procédures et sécuriser les équilibres financiers.</li> <li>• 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</li> </ul>
<p><b>Modélisation</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Récolter, structurer et garantir la qualité et l'exhaustivité des données à mobiliser</li> <li>• Comprendre la problématique et ses enjeux et définir les critères de modélisation dans un objectif de performance</li> <li>• Concevoir et développer des outils de projection, remettre en cause les modèles et les faire évoluer si besoin pour refléter la réalité du terrain d'analyse</li> <li>• Simuler les scénarios potentiels et leurs impacts en fonction des facteurs d'évolution et traduire les résultats en préconisations pour faciliter la prise de décision</li> </ul>
<p><b>Reporting</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Concevoir, suivre et faire évoluer les outils de reporting en lien avec l'activité et les évolutions réglementaires</li> <li>• Produire des reportings et des états de pilotage de qualité dans le respect des délais et en fonction des besoins des parties prenantes</li> <li>• Traduire les chiffres en préconisations accessibles, structurer le message en lien avec l'objectif et communiquer auprès des parties prenantes concernées</li> </ul>

# Manager des Risques Salle de Marchés

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
<b>Conformité</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conformité LCB-FT</li> </ul>	Déclaration de soupçon Droits de communications Maîtrise des outils de pilotage des experts Outils de pilotage du réseau Procédures LCB-FT-SFI - KYC Procédures LCB-FT-SFI - KYT Réglementation et normes LCB-FT-SFI
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conformité Déontologie</li> </ul>	Conflits d'intérêts client/salarié Corruption Faculté de signalement Listes de surveillance et d'interdiction Suivi du Personnel Sensible
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conformité Ethique</li> </ul>	Politique interne d'entrée en relation
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conformité Réglementaire</li> </ul>	Certifications et formations réglementaires Conformité Fiscale Directive MIF / RG AMF Externalisation Finance durable - ESG Règlement MAR Réglementation Américaine RGPD Veille réglementaire
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conformité Salle des marchés</li> </ul>	Directives prospectus EMIR - Produits dérivés SFTR - opérations de financement sur titres
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Dispositifs tutélaire et de contrôle</li> </ul>	Contrôle de second niveau CINTMT Relations avec les autorités de tutelle Reporting
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Risques</li> </ul>	Cartographie des risques Risques de marchés Risques de taux Risques opérationnels
<b>Droit</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Droit civil</li> </ul>	Contrats et obligations Droit de la famille Droit de la responsabilité civile Droit des personnes
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Droit des affaires</li> </ul>	Droit commercial Droit de la concurrence Droit de la distribution Droit de la propriété intellectuelle Droit de la protection des données Droit des contrats Droit des sociétés

# Manager des Risques Salle de Marchés

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
<b>Droit</b>	• Droit des assurances	Des biens Des personnes et des professionnels
	• Droit fiscal	Contrôle fiscal et contentieux fiscal Fiscalité corporate Fiscalité internationale Fiscalité patrimoniale
	• Droit international des affaires	
	• Droit international privé	Droit international privé
	• Droit pénal	Le droit pénal général Le droit pénal spécial Procédure pénale
	• Droit public	Administratif Comptable De l'environnement De l'urbanisme Des collectivités territoriales Des marchés publics Finances publiques
<b>Durabilité</b>	• Critères ESG	Critères de gouvernance Critères environnementaux Critères sociaux
	• Enjeux sociaux et sociétaux	Culture Diversité Egalité Handicap Inclusion Précarité Vivre ensemble
	• Environnement	Climat Ecologie
	• Evaluation engagements ESG	Indicateurs d'évaluation des pratiques responsables Management environnemental Outils et méthodologies d'évaluation des politiques et actions
	• Mutualisme	Raison d'être et valeurs Spécificités du modèle et ses axes d'évolutions Structure organisationnelle
	• Politique & Ambitions Groupe	Agora et vie mutualiste

# Manager des Risques Salle de Marchés

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
<b>Econométrie</b>	• Econométrie	Macro économétrie Méthode d'économétrie Micro économétrie Modèles économétriques
	• Comptabilité analytique	Comptabilité extra-financière liasse fiscale Outil CALIFE Ratios de liquidité Ratios de rentabilité Ratios de solvabilité Soldes intermédiaire de gestion Structure financière Tableau de financement Tableau des flux
<b>Finance</b>	• Comptabilité générale	Budgets Etats comptables Outils et logiciels de comptabilité Réglementation et normes comptables Techniques comptables Techniques de comptabilité bancaire
	• Ingénierie financière	Due Dilligence Montages de financement Structuration de la dette Structuration de la marge Structuration des performances financières
	• Investissements ESG	
	• ISR	Indicateurs ISR
	• Marchés Financiers	Crypto monnaie Flux Taux & Changes Fonds à risque Fonds sécuritaires Marché Actions Marché Obligataire Marché Produits Dérivés Matières premières Places et cours Produits cash Produits complexes Produits structurés Réglementation AMF

# Manager des Risques Salle de Marchés

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
Finance	<ul style="list-style-type: none"> <li>Maths financières</li> </ul>	Corporate Finance LBO
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Opérations de capital</li> </ul>	M&A - techniques d'acquisition M&A - techniques de fusion Private Equity Valorisation d'entreprise
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Valorisation d'entreprise</li> </ul>	Analyse financière boursière Financements spécialisés - syndication Financements spécialisés et produits structurés Valorisation d'entreprise
Langues	<ul style="list-style-type: none"> <li>Anglais</li> </ul>	
Middle & Back Office	<ul style="list-style-type: none"> <li>Bureautique hors Pack Office</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Outils et procédures de gestion</li> </ul>	Outils de gestion Procédures de gestion
Modélisation	<ul style="list-style-type: none"> <li>Modélisation informatique</li> </ul>	Développement de modèles informatiques Modèles de modélisation informatique
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Modélisation mathématique</li> </ul>	Probabilités Statistiques
Projet & Innovation	<ul style="list-style-type: none"> <li>Conduite de Projet</li> </ul>	Construction et gestion de budget Gestion du changement Méthodologie de construction de projet Outils et méthodes de reporting Planification
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Innovation</li> </ul>	Techniques d'idéation
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Intelligence collective</li> </ul>	Facilitation Outils d'animation Techniques d'animation d'ateliers d'IC
	<ul style="list-style-type: none"> <li>MOA</li> </ul>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Pilotage de la transformation</li> </ul>	Définition / structuration de projet de transformation Gestion des parties prenantes Planification de la transformation Reporting Transformation Techniques et processus de transformation
SI & DATA	<ul style="list-style-type: none"> <li>Business Analyse</li> </ul>	Connaissance des différentes offres (banque et filiales) Connaissance des données flux C/C et contrats Connaissance du SIO Statistiques descriptives, analyses bivariées Stratégie Marketing et Commerciale



# Manager des Risques Salle de Marchés

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
<b>SI &amp; DATA</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Data Science</li> </ul>	Analyses/Reporting dynamiques Connaissance des données flux C/C et contrats Connaissance du SIO Data Management/Pré-processing (préparation bases de données) Deep Learning Développement de modèles prédictifs Méthode d'échantillonnage Sélection de variables (prédicteurs à intégrer dans un modèle) Statistiques descriptives, analyses bivariées, arbres de décision Suivi des modèles prédictifs/ciblages Data science Suivi des performances des ciblage Data science Text Mining Veille technologique
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Expertise BI</li> </ul>	Connaissance du SIDU Connaissance du SIO Expertise Data (données contrats, flux, bilancielle, etc.) Optimisation des requêtes en langage FOCUS WebFOCUS/InfoAssist
	<ul style="list-style-type: none"> <li>MOA</li> </ul>	Gestion de projets MOA Outils d'alimentation des dispositifs MOA Outils de suivi de la performance des dispositifs MOA SI Décisionnel
	<b>Sécurité</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Règlementation HSE</li> </ul>
<ul style="list-style-type: none"> <li>Secours à la personne</li> </ul>		Consignes de sécurité Les N° d'urgence SST Techniques et procédures d'évacuation
<ul style="list-style-type: none"> <li>Sécurité des biens et des personnes</li> </ul>		Conditions d'accès dans les locaux Discrétion Dispositif d'urgence Dispositifs de protection Environnement de travail N° d'appel CRITEL ou PC Sécurité Vigilance VIGIPIRATE
<ul style="list-style-type: none"> <li>Sécurité Incendie</li> </ul>		Alerte incendie Cheminement d'évacuation Manipulation extincteurs

# Manager des Risques Salle de Marchés



SAVOIR ETRE	Définitions
<p><b>Apprendre à apprendre</b></p> <p>Capacité à rechercher et mobiliser en permanence les moyens de se développer et d'apprendre. Faire évoluer ses pratiques en fonction de ses nouveaux acquis</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• J'associe les feedbacks et mes analyses personnelles afin de disposer d'une vision objective de mes forces et faiblesses et définir les méthodes les plus adaptées à mon apprentissage</li><li>• Je modifie les comportements que j'adopte habituellement en phase d'apprentissage</li></ul>
<p><b>Assertivité</b></p> <p>Capacité à exprimer ses pensées et ses besoins sans agressivité, sans passivité, sans manipulation.</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• Je réagis de manière calme et assurée dans les situations difficiles pour continuer à livrer de bonnes prestations</li><li>• Je maîtrise mes réactions et agis avec lucidité</li><li>• Je formule une critique constructive</li></ul>
<p><b>Etre acteur du collectif</b></p> <p>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</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• J'organise un travail commun en m'appuyant sur les compétences de chacun</li><li>• Je sais partager des informations dans l'intérêt du groupe</li><li>• Je viens en appui d'un collaborateur dans le besoin</li></ul>
<p><b>Etre centré client</b></p> <p>Capacité à mettre le client 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</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• Je tiens compte de l'intérêt du client dans mes décisions</li><li>• J'adapte ma posture en fonction de la personne en face</li></ul>
<p><b>Etre proactif</b></p> <p>Capacité à anticiper et agir de manière proactive pour atteindre un objectif ou résoudre un problème. Capacité à prendre des initiatives, à être prévoyant et à ne pas attendre que les choses se passent avant de réagir</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• Je suis capable de gérer des projets de manière proactive en identifiant les obstacles et en les surmontant</li><li>• Je fais preuve d'anticipation en identifiant les tendances du marché et je propose des solutions novatrices</li></ul>
<p><b>Etre responsable</b></p> <p>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</p>	<ul style="list-style-type: none"><li>• Je tiens compte des conséquences de mes choix et les assume</li><li>• Je sais me remettre en cause et accepter la critique</li></ul>

# Manager des Risques Salle de Marchés



SAVOIR ETRE	Définitions
<p><b>Faire preuve de courage</b></p> <p>Capacité à affronter résolument les questions difficiles et dire ce qui doit être dit</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Je suis connu pour exprimer mes opinions de façon directe et respectueuse</li> <li>• Je communique ce qui doit être dit</li> <li>• Je témoigne d'une maîtrise face aux désaccords ou aux défis</li> <li>• Je me montre prêt à apprendre et à résoudre les problèmes</li> <li>• Je sais dire "non" et l'assume</li> </ul>
<p><b>Faire preuve de flexibilité</b></p> <p>Capacité de 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</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Je trouve des solutions différentes pour résoudre des problèmes complexes</li> <li>• Je m'adapte facilement à de nouvelles situations de travail</li> <li>• Je suis capable de travailler efficacement avec des personnes ayant des points de vue différents</li> <li>• J'ai conscience d'évoluer dans un environnement changeant et incertain</li> </ul>
<p><b>Faire preuve d'esprit critique</b></p> <p>Capacité à identifier l'ensemble des aspects d'un sujet et les examiner d'une manière critique pour formuler un point de vue étayé. Etre poussé par le désir d'en savoir plus sur les choses, les personnes ou les événements</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• J'effectue une analyse claire, en tenant compte des différents aspects, de leurs causes et de leurs liens réciproques</li> <li>• Je pose un diagnostic objectif</li> <li>• Je conçois et évalue des scénarii multiples</li> </ul>
<p><b>Innovation</b></p> <p>Capacité à sortir du cadre existant en proposant des idées nouvelles qui conviennent aux clients et/ou à l'organisation; se montrer ouvert et curieux à de nouvelles tendances</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Je fais preuve d'ouverture à l'égard de nouvelles idées et de la façon de voir les choses</li> <li>• J'emprunte une approche différente pour aborder un problème</li> <li>• J'innove dans ma façon d'agir afin d'apporter d'avantage de succès à l'entreprise</li> </ul>
<p><b>Porter nos valeurs</b></p> <p>Capacité à s'inscrire dans les valeurs portées par le groupe en tant qu'entreprise à mission – diversité, inclusion, équité, exemplarité, droit à l'erreur - et à les diffuser dans ses pratiques et à ses collaborateurs</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Je vise l'exemplarité</li> <li>• Je mets en avant les valeurs de l'entreprise</li> </ul>
<p><b>Savoir communiquer</b></p> <p>Capacité à écouter et comprendre. Savoir appréhender les différentes techniques de communication (écrit, oral, non-verbal), adapter sa communication et faire preuve de pédagogie</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Je fais preuve d'empathie</li> <li>• Je m'adapte à mon interlocuteur</li> <li>• Je choisis le canal de communication pertinent</li> </ul>