



DÉPOSITAIRE DE SYSTÈMES D'INFORMATION FINANCIERS

Références des missions en Gestion des Risques



DÉPOSITAIRE DE SYSTÈMES D'INFORMATION FINANCIERS

Direction des Risques

- **LE CLIENT**

DIRECTION DES RISQUES – *Service Calculs, Modèles et Reporting*

Depuis janvier 2011, ALGOFI accompagne la Direction des Risques sur la maîtrise d'ouvrage bancaire et stratégique des outils de notation pour l'ensemble du périmètre (Corporates, Collectivités Locales, Banques, PME / TPE, Real Estate, Brokers, Fonds Régulés, Hedge Funs, Assurances...).

ALGOFI officie en tant qu'ISP (Information System Process).

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Bâle II, Risque de crédit, Calcul des paramètres bâlois PD et LGD

- **NOTRE MISSION**

- **Rédaction des expressions de besoins métier / risques** : identification, priorisation et planification des travaux de maîtrise d'ouvrage applicative à mener pour 2011 – 2012
- **Pilotage des travaux des équipes IT (MOA applicative)** : validation des spécifications fonctionnelles et des plans / cahiers de recette
- **Homologation bancaire des outils de notation** : tests utilisateurs sur l'interface de notation pour le calcul des notes et pour le calcul des LGD à l'origination ; production du Procès Verbal d'homologation bancaire
- **Participation aux phases de conduite du changement** : production de supports/guidelines, pilotage des actions de qualité de données

Direction des Risques

● LE CLIENT

DIRECTION DES RISQUES – *Projet Calculateur Central Capital Crédit*

De mars 2010 à mars 2011, ALGOFI a accompagné la Direction des Risques sur la maîtrise d'ouvrage applicative du calculateur des fonds propres réglementaires basé sur l'outil Fermat CAD.

Durant cette période, ALGOFI a également été responsable de la réorganisation et de la constitution du fonds documentaire 4C – Fermat en vue de l'inspection de l'Autorité de Contrôle Prudentiel.

● DOMAINE FONCTIONNEL

Bâle II, Risque de crédit, Calcul du RWA, Titrisation, Grands Risques Réglementaires, Fermat CAD

● CHIFFRES CLES

- Durée : 12 mois
 - Equipe de 2 consultants
-

● NOTRE MISSION

- **MOA applicative dans l'équipe 4C** : rédaction de cahiers des charges, de stratégies de recette et de cahiers de recette
 - Flux d'alimentation de Fermat
 - Mis en place de modules Custom
 - Calcul de LGD spécifiques à la Société Générale en méthodologie IRBA
 - Evolution des modules de titrisation
- **Réorganisation et constitution du fonds documentaire 4C** : mise à jour des documents utilisateurs, classification par domaine fonctionnel, rédaction d'une documentation Chapeau (historique et gouvernance du projet 4C, présentation du fonds documentaire)

Direction des Risques

- **LE CLIENT**

DIRECTION DES RISQUES – *Projet B2T (Bâle 2 Trading)*

De janvier 2010 à juin 2011, ALGOFI a accompagné la Direction des Risques sur la maîtrise d'ouvrage applicative du projet Bâle 2 Trading.

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Bâle II, Risque de contrepartie, Risque de marché, Titrisation, IRC, VaR

- **CHIFFRES CLES**

- Durée : 18 mois
 - Equipe de 2 consultants
-

- **NOTRE MISSION**

- **MOA applicative dans l'équipe B2T** : calcul du risque sur le portefeuille de titrisation du trading book et calcul du risque incrémental (IRC) sur le périmètre crédit
 - Étude, cadrage et spécification des besoins
 - Animation de réunions sur l'avancement du projet
 - Mise en place de la stratégie de validation des calculateurs et suivi des projets et des livrables de la MOE
 - Études d'impact et recette des différentes versions livrées (analyse technique et fonctionnelle, benchmark des données du trading book et reporting à l'équipe de collecte)
 - Gestion des anomalies sur Quality Center
 - Coordination des équipes MOE/MOA dans la phase de validation des calculateurs

Direction des Systèmes d'Informations – MOA Risque Pays

● LE CLIENT

Maîtrise d'ouvrage Risque Pays

Depuis février 2012, ALGOFI accompagne la maîtrise d'ouvrage sur l'application Système d'Information Risque Pays.

● DOMAINE FONCTIONNEL

Risque de crédit, Risque de marché, Risque pays, Instruments financiers

● CHIFFRES CLES

- Equipe de 2 consultants
-

● NOTRE MISSION

- **Mise en place du reporting réglementaire Banque de France** : tester les nouvelles évolutions demandées par la Banque de France
 - Rédaction des cahiers de tests et synthèse des tests réalisés , suivi des anomalies sur Quality Center
 - Vérification, lors de la validation fonctionnelle, que le reporting généré répond aux spécifications de la Banque de France
 - Etre le support aux utilisateurs et à la maîtrise d'ouvrage bancaire lors de la phase d'homologation bancaire
- **Migration de l'application SIRP vers un nouveau site d'exploitation** :
 - Rétro-documentation de l'application
 - Validation fonctionnelle et bancaire de l'application sur le nouveau site d'exploitation. Développement d'outils permettant d'industrialiser la non-régression fonctionnelle entre les 2 sites
 - Etre le support fonctionnel aux utilisateurs et à la maîtrise d'ouvrage bancaire

Investment Banking

- **LE CLIENT**

Direction informatique de la banque d'investissement

Depuis janvier 2011, ALGOFI accompagne département informatique en charge des activités risques, référentiels et technologies financières sur la maîtrise d'ouvrage d'une application qui a été mis en place en vue de :

- ▶ stocker les données du risque de crédit (RWA)
- ▶ permettre la modification et le retraitement de ces données par des utilisateurs habilités avant consolidation au niveau du Groupe
- ▶ assurer l'échange des données entre la banque d'investissement et le Groupe

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Risque de crédit, Bâle III, CVA, EEPE

- **NOTRE MISSION**

- **La mise à la cible de l'application dans le cadre de la mise en place de la CVA et de l'EEPE :**
 - Rédaction des spécifications fonctionnelles détaillées
 - Procès-verbal d'homologation fonctionnelle des développements
 - Conduite du changement / formation des utilisateurs
- **Le développement des exigences réglementaires dans le cadre de Bâle 3 nécessite d'adapter les fonctions et les données logées dans l'application :** reliquat d'évolutions liées aux exigences Bâle 2 Trading

Direction des Risques

- **LE CLIENT**

DIRECTION DES RISQUES – Pôle Ingénierie

De 2007 à 2010, ALGOFI a accompagné l'équipe Ingénierie Marché du département Risk Analytics.

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Bâle II, Risque de contrepartie, Risque de marché, VaR, Monte Calo, produits dérivés

- **CHIFFRES CLES**

- Durée : 36 mois
 - Equipe de 3 consultants
-

- **NOTRE MISSION**

- **Ingénierie financière et MOA applicative sur le logiciel de calcul du risque de contrepartie :**
 - Développement transversal du logiciel de VaR marché, d'outils d'analyse des VaR paramétrique et Monte-Carlo et de leurs variations
 - Suivi des méthodologies Front Office et contrôle de leur bonne restitution dans la mesure de risque de marché
 - Etude méthodologique, conception, maquettage, spécification et tests des évolutions nécessaires pour capter tous les risques de marché

Direction des Risques

- **LE CLIENT**

DIRECTION DES RISQUES – Pôle Global Risk Analytics

Depuis mai 2011, ALGOFI accompagne l'équipe Mesures Risques de Crédit en charge du modèle de mesure économique du risque de contrepartie sur opérations de marché (méthodologie de type Monte Carlo) et des évolutions liées à l'outil de calcul associé, AMeRisC.

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Bâle II, Risque de contrepartie, Risque de marché, VaR, Monte Calo, produits dérivés

- **NOTRE MISSION**

• **MOA et conduite de projet sur les activités de marché dans le cadre de la convergence de l'outil existant vers l'outil cible :**

- intégration de nouveaux produits dans le calcul d'exposition potentielle
- définition de nouveaux axes de risque
- calibrage de processus stochastiques
- implémentation de nouveaux pricers
- évolution des flux d'alimentations et des traitements associés

Direction Informatique des marchés de capitaux

- **LE CLIENT**

Pôle Equity dérivatives

De septembre 2007 à janvier 2010, ALGOFI a accompagné l'équipe en charge de la surcharge autour du progiciel Sophis RISK. Il s'agit d'intégrer de nouveaux produits exotiques et de mettre en place l'interface avec les librairies de pricing développées par la recherche Quantitative.

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Risque de marché, produits dérivés, actions

- **NOTRE MISSION**

- Développement (refactoring et architecture) de l'application de gestion de position :
 - développement d'un module d'assistance à la saisie de transactions
 - intégration des pricers dans cette application
 - maintenance évolutive et corrective

Direction des Risques

- **LE CLIENT**

DIRECTION DES RISQUES – MOA Bâle II

De juin 2007 à décembre 2009, ALGOFI a accompagné le projet Bâle II pour l'homologation en IRBA sur le périmètre des particuliers.

- **DOMAINE FONCTIONNEL**

Bâle II, Risque de crédit, Calcul des paramètres bâlois PD et LGD

- **NOTRE MISSION**

- **MOA sur la partie pilotage** : rédaction d'expression de besoins, de cahier des charges, de stratégies de recette, réalisation de tests fonctionnels
 - constitution du flux Fermat (réalisation du cahier des charges, mapping SI Fermat, pilotage des ateliers de travail)
 - élaboration d'un Datawarehouse pour le Backtesting des modèles de PD et de LGD sur le périmètre des Particuliers
 - élaboration d'une base d'historique des notes Bâle II et des scores d'octroi