APPEL
À CANDIDATURES
EXTERNES

Jeudi 13 octobre 2022

Réf. CNMR 13102022

Gestionnaire Risques Modélisation

Dans le cadre du renforcement de ses structures, la **Caisse de Dépôt et de Gestion**, lance un appel à candidatures externes pour pourvoir un poste de **Gestionnaire Risques Modélisation**, rattaché à la **Direction des Risques Financiers & Pilotage Prudentiel**, relevant de son **Pôle Risk Management**.

I. Présentation de la Caisse de Dépôt et de Gestion :

La CDG est une institution financière publique exerçant un double mandat :

- Collecter et sécuriser l'épargne réglementée, notamment les dépôts de la CNSS, de la Caisse d'Épargne Nationale, des professions juridiques et des consignations.
- Canaliser l'épargne de long terme vers des investissements rentables et générateurs de croissance socioéconomique.

La mission de la CDG est de créer de la valeur :

- Sécuriser et faire fructifier l'épargne des déposants.
- Appuyer la stratégie nationale de développement à travers des projets créateurs d'externalités positives.

Pour mener à bien cette mission, la CDG déploie une stratégie Groupe articulée autour de métiers spécifiques et couvrant de larges pans de l'économie marocaine.
Si ces métiers diffèrent par les moyens alloués et les champs d'intervention privilégiés, leur finalité converge vers un seul et unique objectif : la création de valeur réelle au service des enjeux de développement du Royaume.

II. Principales missions du Gestionnaire Risques Modélisation :

❖ Modélisation des risques financiers et d'investissement :
- Concevoir et implémenter les outils et les modèles d'évaluation, d'analyse et de traitement des risques financiers et d'investissement (VaR, corrélations entre facteurs de risque, modèle d'allocation des fonds propres, perte valeur risque…)
- Développer et assurer la maintenance des modèles internes de quantification des risques financiers (marché, risques structurels de taux et liquidité, concentration…)

❖ Modélisation du risque de crédit/contrepartie :
- Garantir la production des notations internes et des provisions réglementaires (ECL) pour déprécation au titre des normes IFRS
- Participer à la maintenance et l'évolution des systèmes de notation interne (rating, PD, PD FL, LGD, …)
- Veiller à la conformité des systèmes de modélisation du risque de crédit avec les exigences réglementaires et les bonnes pratiques

❖ Validation des modèles :
- Conduire la revue indépendante des travaux de modélisation réalisés par les autres structures
- Participer la conception des outils d'analyse de la robustesse et la performance des modèles
- Participer à la mise en place et le suivi du dispositif de documentation des modèles

Retrouvez tous les appels à candidatures internes sur MyONECDG : https://myonecdg.cdg.ma/sites/intranet

APPEL À CANDIDATURES EXTERNES

III. Profil recherché :

- De formation supérieure Bac+5, de type grande école d'ingénieur, université ou MBA
- Une expérience professionnelle d'environ 3 ans dans le domaine de la modélisation (finance et/ou risques)
- Excellente maitrise des outils de modélisation financière et de la gestion des risques
- Très bonne maîtrise des outils statistiques et de modélisation ainsi que des langages de programmation (SAS, MATLAB, R, VBA, C++, …)

IV. Aptitudes liées à la fonction :

- Forte capacité d'analyse et de synthèse
- Sens de la rigueur et de responsabilité
- Sens aigu de l'organisation et des délais
- Aisance à communiquer et à traiter avec différents interlocuteurs

Toute personne intéressée par ce poste est invitée à postuler via le lien suivant : https://recrutement.cdg.ma/Agirhcv

La date limite de dépôt des candidatures est fixée au **27 octobre 2022**.

Poste basé à **Rabat.**

NB : Pour tout complément d'information ou besoin d'assistance envoyer votre demande sur l'adresse suivante : RecrutementCDG@cdg.ma

Retrouvez tous les appels à candidatures internes sur MyONECDG : https://myonecdg.cdg.ma/sites/intranet