



# Bruno Boggiani

## EXPERT FINANCE

RISQUE - STRATEGIE - FINANCE VERTE - PRODUITS STRUCTURES



55 avenue Victor Hugo, 1750 Limpertsberg,  
Luxembourg



+33 6 70 20 13 13



bruno.boggiani@strateggyz.com

### 1. Compétences Fonctionnelles

#### Finance & Risque

- Analyse de risque de crédit, risque opérationnel, marché et ESG
- Contrôle interne et externe, plan de contrôle, système d'alerte
- Suivi des recommandations IG, régulateurs, auditeurs, Due diligence
- Élaboration et suivi du Risk Appetite Statement (RAS)
- Évaluation indépendante 2e ligne de défense ESG
- Gestion de portefeuille, suivi portefeuille, early warning, watchlist & doubtful debtors
- Structuration, pricing et commercialisation de produits structurés (Green CLN, Repack, Tranche Index)
- Stratégie financière : Marchés de capitaux, dérivés, fonds et produits hybrides

#### Finance durable, ESG & Green

- Structuration du Prudential Transition Plan (PTP)
- Gap Analysis : Groupe vs Local vs Réglementation
- Intégration Taxonomie, SFDR, CSRD, TCFD, RTS, IFRS17, Art.9, Art.29 LEC
- Conception et suivi reporting financier & extra-financier (DPEF, DEU, RSE, Taxonomie)
- Gouvernance durable (COPIL, COPRO, PTP, stratégie d'engagement ESG)
- Veille réglementaire et construction d'indicateurs ESG
- Conception de formations & certification en finance verte (RS France Compétences)

#### Compétences en Gestion de Projet / Management

- Pilotage de projets complexes multi-pays (France, Luxembourg, UK)
- Coordination d'équipes transverses (Risk, Finance, IT, CSR, BO, MO, FO)
- Gouvernance projet (CA, COPIL, COPRO, Reporting, communication)
- Suivi de roadmap stratégique, KPI, tableau de bord Power BI
- Gestion de planning, budget, priorisation, livrables et reporting CFO/CEO

#### Audit & Conseil

- Diagnostic organisationnel et cartographie des risques
- Conseil réglementaire et conformité : EBA, ECB, AMF, CSSF, Taxo UE,
- Contrôle & Analyse de performance et recommandations stratégiques
- Production de rapports d'audit et notes d'opportunité

### 2. Compétences IT & Outils

Outils financiers, Data & Reporting :

- Power / Power BI / Murex / MEB / Calypso / eFront / Summit / Maestro / Hera
- Excel VBA / Google AI / GCP / Airtech AI / Copilot / Operis / Orchestra / Coda
- Bloom / Reuters / Fininfo

### 3. Gouvernance & Leadership

- Encadrement d'équipes projet / direction transverse
- Speaker, Animation de conférences, débats, interviews et tables rondes ESG
- Création et direction de Green Finance Média (10 000 abonnés, 4 000 publications)
- Partenaire presse : Les Échos, Challenges, L'Opinion, Bloom, Reuters, AFP, Morningstar
- Stratégie de communication institutionnelle
- Représentation institutionnelle et coordination avec autorités régulatrices

### 4. Formation & Transmission

- Conférencier en Risk Management (ESG Paris – MBA Finance)
- Formation aux typologies de risques, méthodologie, mesures, calculs
- Conception de modules e-learning et certification RS
- Animation d'ateliers pédagogiques (Taxonomie, CSRD, labels ESG)
- Titulaire : MBA Finance, Master Finance de marché, GFA Green Finance Analysis
- Agile, Lean6Sigma, SAFE

### 5. Langues & Interculturalité

- Anglais : courant / fluent
- Expériences internationales : Paris, Londres, Luxembourg
- Collaboration avec émetteurs, institutions et régulateurs européens

#### Mes activités :

Finance Consulting Communication

#### Mes Parutions :

Linkedin Prix Green 2025 Vision Forbes Les Echos

*Expert en finance, avec plus de 15 ans d'expérience dans la conduite de projets complexes pour des banques, asset managers et institutionnels.*

*Je m'investis pleinement dans chaque mission avec une attitude positive, constructive et bienveillante.*

*Convaincre, négocier et coordonner des stratégies pour atteindre un objectif clair fait partie de mon ADN.*

*J'analyse et contrôle avec rigueur, tout en gardant la remise en question et l'adaptabilité nécessaires*

*face à des interlocuteurs variés : dirigeants, experts, auditeurs, analystes, ou équipes opérationnelles (BO, MO, FO, IT).*

*J'apprécie porter un projet, mobiliser et rassembler les équipes comme les parties prenantes,*

*et créer une dynamique collective orientée résultat.*

*Mes sujets de prédilection : La finance, le risque, la stratégie, la finance durable et les produits structurés.*

#### BGL BNP – Chef de projet Risk et Risk ESG – Luxembourg

8 mois

Chef de projet Risk au sein de l'équipe Enterprise Risk Architecture (BGL BNP Paribas Luxembourg), j'ai mené une gap analysis complète entre les politiques groupe, locales et réglementaires (EBA, CSSF, CSRD, Taxonomie UE) pour garantir la conformité du crédit durable.

J'ai structuré et piloté le Prudential Transition Plan (PTP), défini les métriques et la gouvernance ESG, et renforcé la seconde ligne de défense via la mise à jour des procédures, la validation produits et le suivi des recommandations régulateurs.

Enfin, j'ai coordonné les contrôles et reportings ESG, consolidant l'intégration du risque durable dans le cadre prudentiel BGL.

#### Eiffage – Chef de projet DPEF – Paris

2 ans

Chef de projet au sein du groupe Eiffage, j'ai piloté la mise en conformité CSRD, DPEF et Taxonomie, incluant l'analyse énergétique et la structuration des reportings ESG.

J'ai conçu et automatisé le reporting extra-financier sous Power BI, coordonné les instances de gouvernance RSE, et dirigé un projet d'IA (Google AI) pour la labellisation des données.

Ces actions ont renforcé la fiabilité, la traçabilité et l'efficacité du reporting durable du groupe.

#### Strateggyz – Chargé d'affaires – Paris

3 ans

Chargé d'affaires chez Strateggyz, j'ai assuré la mise en relation entre investisseurs et émetteurs à Paris, Londres et Luxembourg.

J'ai conçu des produits structurés et solutions d'épargne ESG, accompagné les clients dans leurs stratégies patrimoniales, et animé une communauté de 50 000 investisseurs.

J'ai également organisé plusieurs roadshows internationaux, renforçant le réseau institutionnel de Strateggyz.

#### Nomura – Chef de projet Produits Structurés Green – Londres

1 an

Chef de projet Produits Structurés Green chez Nomura Londres, j'ai lancé un desk dédié aux produits ESG (CLN, Repack, Tranche Index) et défini la stratégie de structuration et de distribution.

J'ai supervisé le pricing, la gestion du risque et le reporting, tout en intégrant les indices MSCI ESG, Sustainalytics, Morningstar et Moody's.

Ce projet a positionné Nomura comme acteur clé des produits structurés durables, alliant innovation et performance responsable.

#### GFA – Chef de projet Green Finance – Paris

3 ans

Chef de projet chez Green Finance Analysis (GFA), j'ai piloté la création du Certificat en Finance Verte, première certification française dédiée à la finance durable.

J'ai conçu la plateforme et les contenus pédagogiques (Taxonomie, SFDR, CSRD, labels, ESG) et mené une étude d'opportunité fondée sur 200 publications.

Ce travail a conduit au dépôt du Répertoire Spécifique auprès de France Compétences et positionné GFA comme référence en formation à la finance durable.

Chef de projet Média au sein de Green Finance, j'ai développé une activité dédiée à la finance verte, réunissant plus de 10 000 abonnés institutionnels et 4 000 publications diffusées via Les Échos, Bloomberg, Reuters, AFP ou Morningstar.

J'ai coordonné la stratégie éditoriale et réglementaire (Taxonomie, SFDR, CSRD) et animé des tables rondes et conférences sur les enjeux ESG.

Ce travail a positionné Green Finance comme média de référence sur la finance durable et l'impact responsable.

J'ai piloté la création du Certificat en Finance Verte, première certification française dédiée à la finance durable. J'ai conçu la plateforme et les contenus pédagogiques fondée sur 200 études.

#### BNP – Deputy Analyst – Londres

10 ans

Deputy Analyst au sein de la Direction financière BNP (Paris & Londres), j'ai assuré le suivi du PnL et des risques sur l'ensemble des activités de marché, en lien direct avec le CFO.

J'ai coordonné la migration et l'évolution des outils Power, Murex, Calypso et Maestro, et conduit des projets Agile / Lean6Sigma pour fiabiliser les reportings financiers.

#### CM-CIC – Chef de projet Pôle Service Client – Paris

1 an

Chef de projet au CM-CIC Paris, j'ai créé le Pôle Service Client, interface entre Risk Management et Front Office.

J'ai automatisé le passage d'ordres structurés sous Excel/VB, conçu un modèle de suivi VaR et assuré le reporting risques et réglementaire Bâle.

Mon rôle a renforcé la communication Clients–Sales–Structureurs et optimisé la gestion des produits dérivés et de couverture.



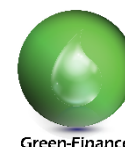
- **Assister ROO / CRO** – Risk Operating Officer / Chief Risk Officer sur Enterprise Risk Architecture (ERA), Operational Permanent Control, Transversal Activities, et Strategic Analysis
- **Réalisation d'une Gap Analysis approfondie** sur les dispositifs Risk BGL liés aux activités d'octroi de crédit, afin d'évaluer l'alignement entre politiques et procédures locales, standards Groupe et exigences réglementaires (CSSF, AMF, ACPR, EBA, CSRD, EU Taxonomy).
- **Pilotage du Prudential Transition Plan (PTP)** : définition des ambitions, du framework, des outils de Risk Management, et structuration des actions concrètes.
- **Déclinaison du PTP** autour des objectifs stratégiques, roadmap, cibles, métriques, gouvernance, stratégie d'implémentation et d'engagement.
- **Définition et déploiement des politiques de risque de crédit** : Élaboration et mise en œuvre des politiques de risque de crédit pour BEL, BDL et BPL, intégrant les spécificités des portefeuilles Corporate, Retail et Institutional.
- **Validation des nouveaux produits et activités** : Contribution au processus de validation des nouveaux produits et activités, avec analyse d'impact Risk et conformité ESG avant mise en œuvre.
- **Suivi des recommandations des auditeurs et régulateurs** : Supervision de la mise en œuvre des recommandations des auditeurs internes, régulateurs et Inspection Générale, avec reporting d'avancement à la Direction du Risk.
- **Identification et évaluation des risques** : Supervision de l'identification, de la qualification et de l'évaluation des risques (crédit, opérationnels, ESG, réputationnels).
- **Contrôles permanents et systèmes d'alerte** : Réalisation et coordination de contrôles permanents, suivi des indicateurs de risque et mise en place de systèmes d'alerte automatisés.
- **Renforcement de la seconde ligne de défense ESG** : Assurer l'évaluation objective, l'indépendance de la fonction et la conformité des décisions de crédit durable.
- **Harmonisation des pratiques Risk** : Contribution active aux RISK Transversal Activities, harmonisation des pratiques entre Risk Credit, Risk Operational, Risk ESG et Risk Strategic Analysis.
- **Mise à jour du Risk Appetite Framework** : Participation à la mise à jour du Risk Appetite Framework et des limites prudentielles en intégrant les facteurs environnementaux et sociaux.
- **Sensibilisation et formation** : Animation de sessions de sensibilisation et de présentation des enjeux Risk & ESG auprès des équipes internes et de la direction.
- **Analyse prospective des risques** : Analyse spécifique des risques avec une vision prospective, anticipant les dégradations éventuelles.
- **Coordination et communication transversale** : Coordination des exercices Risk ID Banque/Reporting ICAAP, suivi des budgets/dépenses, et communication adéquate au sein de la fonction Risk.
- **Procédures** : Risk ID ; RAS Risk Appetite Statement ; ESG Tagging ; ESG Lending ; ESG Assessment ; Residential Real Estate ; Collateral Valuation ; Impact Entrepreneurship ; Global Credit Policy ; Commercial Real Estate ; Tac/Nac ; Non-Performing and Forborne Exposures ; Watchlist And Doubtful Debtors Non Retail Rating Principles – Ndod ; Offshore Financing ; Information

- Pilotage global du projet de **mise en conformité DPEF, CSRD et Taxonomie européenne**, dans le cadre du déploiement du reporting extra-financier du groupe.
- Conception et déploiement du **rapport de durabilité** intégrant les dimensions environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).
- Réalisation d'une **analyse comparative (benchmark DEU)** auprès de 25 grandes sociétés du secteur afin d'identifier les meilleures pratiques de reporting.
- Suivi et **analyse détaillée des consommations énergétiques** (eau, gaz, électricité, carburant) pour alimenter les indicateurs de performance ESG.
- Construction d'un **framework d'indicateurs Taxonomie & CSRD**, permettant le suivi des contributions durables par activité.
- Définition du **processus de collecte, validation et consolidation** des données ESG issues des filiales et entités opérationnelles.
- Conception et automatisation du **reporting Power BI**, garantissant la fiabilité, la traçabilité et la mise à jour dynamique des indicateurs.
- Utilisation de **Google AI** pour automatiser la **labellisation, la classification et la production de données extra-financières**.
- Mise en production des **processus automatisés** pour fiabiliser la chaîne de reporting et réduire les délais de clôture.
- Supervision des **instances de gouvernance** (COPRO, COPIL) afin de suivre la mise en œuvre et les arbitrages stratégiques RSE.
- Pilotage de l'activité en coordination avec les équipes Risk, RSE, Finance et IT pour assurer la cohérence et la qualité des livrables.
- Mise en place d'un **système d'audit interne ESG** permettant la vérification et la validation des informations collectées.
- Suivi des **indicateurs de performance non financière (KPI)**, incluant les émissions GES, la consommation d'énergie et la circularité.
- Élaboration de **notes d'analyse et de synthèse** à destination du COMEX et du comité RSE.
- Définition des **axes d'amélioration continue** du reporting ESG : digitalisation, granularité, automatisation et conformité.
- Revue de la cohérence entre les **objectifs stratégiques RSE** et les exigences réglementaires européennes (EBA, CSRD, Taxonomie).
- Contribution à la **stratégie de publication et de communication** du rapport de durabilité à destination des investisseurs et partenaires institutionnels.
- Renforcement de la **gouvernance des données ESG**, en alignant les pratiques internes avec les standards européens et les attentes de l'audit.
- Participation à la **structuration du dispositif CSRD** pour garantir la conformité du groupe aux nouvelles exigences 2025.



- Conseil global en **stratégie financière et patrimoniale**, avec approche sur mesure adaptée aux profils investisseurs institutionnels et privés.
- **Mise en relation entre investisseurs et émetteurs** à l'international (Paris, Londres, Luxembourg) dans le cadre d'opérations structurées et placements privés.
- **Conception, structuration et commercialisation de produits structurés** sur mesure, en partenariat avec des contreparties telles que **Marex** et **Nortia**.
- Élaboration de **stratégies d'épargne et d'investissement ESG**, intégrant rendement, risque et impact durable.
- Analyse des **marchés de capitaux**, identification d'opportunités sur produits dérivés, obligations, fonds et actifs alternatifs.
- Conseil sur la **diversification d'actifs**, l'optimisation fiscale et la gestion du risque (Risk/Return, volatility control, drawdown).
- Accompagnement des clients dans la **sélection de solutions d'assurance-vie** françaises et luxembourgeoises (Swisslife, Axa).
- Définition de **stratégies financières et ESG** alignées avec les standards européens (SFDR, Taxonomie, CSRD).
- Conception de **portefeuilles thématiques** (énergies renouvelables, santé, technologies, mobilité durable).
- Participation à la **due diligence** des partenaires émetteurs et suivi de la conformité produit.
- Animation d'une **communauté de plus de 50 000 traders et investisseurs**, partage d'analyses, formation et veille de marché.
- Organisation et animation de **roadshows investisseurs** et conférences pour promouvoir les solutions d'investissement et produits ESG.
- Développement d'une **stratégie de communication financière** et de diffusion d'information à valeur ajoutée.
- Coordination des **partenariats institutionnels et bancaires**, négociation de conditions commerciales et d'accès produits.
- Suivi post-trade, reporting de performance et analyse PnL sur produits structurés et portefeuilles d'épargne.
- Formation et sensibilisation des clients à la **lecture des marchés, à la gestion de position et au money management**.
- Contribution à la **conception de supports pédagogiques** (analyses, webinaires, fiches produits) pour la vulgarisation financière.
- Participation à la **veille concurrentielle et réglementaire** sur les produits d'investissement, fiscalité et durabilité.
- Développement de **scénarios de stratégie de marché** et simulations de performance en fonction des taux et de la volatilité.

- Pilotage du **lancement d'un desk dédié aux produits structurés Green**, intégrant conception, structuration, marketing et reporting, au sein de la division Global Markets.
- Définition de la **stratégie de structuration et de commercialisation** pour une nouvelle gamme de produits à composante ESG : CLN, CLN Index, Repack et Tranche Index.
- Réalisation d'une **analyse approfondie des besoins des investisseurs institutionnels** en matière de produits structurés durables et alignés Taxonomie UE.
- Conception et documentation de la **gamme de produits ESG-linked**, conciliant performance financière et critères environnementaux mesurables.
- Sélection des **indices de référence** : MSCI ESG, Bloomberg ESG, S&P Global ESG Rank, Sustainalytics Risk Score, Morningstar et Moody's ESG Rating.
- Mise en place du **process de pricing, stress testing et risk assessment** sur les structures complexes à effet de levier.
- Développement d'une **stratégie de distribution et de go-to-market** adaptée aux investisseurs institutionnels européens.
- Coordination des équipes FO, MO et BO pour la **structuration, documentation et validation réglementaire** des produits ESG.
- Conception des **reportings produits et ESG impact reports**, en conformité avec les standards internationaux de transparence.
- Gestion des paramètres clés de structuration : **protection du capital, rendement, fiscalité, effet de levier, maturité, devise et diversification**.
- Élaboration et validation de structures innovantes : Single name CLNs sur copro/index/tranche, Repack, Green bonds
- Mise en œuvre d'une **gestion rigoureuse du risque de crédit, de contrepartie et de marché**, incluant PnL monitoring et Credit Exposure limits.
- Sélection et qualification des **opérateurs et contreparties** (banques, intermédiaires, SPV), avec analyse de signatures et ratings (Single A / BBB+).
- Optimisation du **risk/return trade-off** : arbitrage entre protection (Z 80%) et rendement via structuration coupon.
- Mise en place de **reportings ESG et impact assessments** mesurant la contribution réelle à la finance durable.
- Pilotage des **campagnes de communication et de diffusion** sur les produits : publications dans FT, AFP, Bloomberg, Reuters, Moody's, Green Finance.
- Développement d'approches innovantes sur les **Green Repacks**, valorisant l'ingénierie financière au service de la transition durable.
- Contribution à la **positionnement stratégique de Nomura** comme acteur clé de la structuration durable, combinant innovation, conformité et performance responsable.



- Conception et déploiement d'une **nouvelle activité média dédiée à la finance verte**, couvrant la stratégie de développement, la communication et la valorisation des meilleures pratiques ESG.
- Pilotage de la **croissance du média Green Finance**, rassemblant plus de **10 000 abonnés institutionnels** et **4 000 publications**, diffusées via **Les Échos, AFP, Bloomberg, Reuters, Yahoo, Morningstar, Challenges**.
- Développement de **partenariats stratégiques** avec médias et institutions pour renforcer la visibilité et la légitimité du média sur la scène ESG européenne.
- Accompagnement d'un portefeuille de **clients majeurs** (Fidelity, Ecofi, Candriam, Ofi AM, Stoxx, Generali, Pictet Commission européenne, ERAFP, PREFON, BNP, AG2R, FINANSOL, AF2I, Horizon, AFTE, La Française, LFDE, ...).
- Suivi réglementaire complet sur la **Taxonomie, SFDR, CSRD, IFRS17, TCFD, RTS, NFRD, Art.9, Art.29 LEC et TEE**, avec production de dossiers analytiques.
- Réalisation de **dossiers thématiques** sur les grandes problématiques ESG : greenwashing, socialwashing, sélection d'ODD, labels, mobilité électrique, gouvernance et critères extra-financiers.
- Animation d'**interviews, tables rondes, conférences et débats** pour promouvoir la finance durable auprès des acteurs institutionnels et privés.
- Mise en relation et coordination entre **Asset Managers, institutionnels et émetteurs**, facilitant les échanges sur les produits et process "Green".
- Conception et diffusion d'**articles pédagogiques et études d'impact** sur la finance durable, la déontologie, les fraudes et la réglementation.
- Élaboration et supervision de la **stratégie éditoriale et de communication** sur l'impact du Green et des critères ESG dans les médias partenaires (Financial Times, Forbes, L'Opinion, Challenges).
- Conception et pilotage d'une **activité de formation certifiante** : création du **Certificat en Finance Verte – Green Finance Analysis (GFA)**.
- Élaboration de la **plateforme de formation**, de la stratégie de commercialisation et de communication de l'offre pédagogique.
- Rédaction et dépôt du **Répertoire Spécifique (RS)** auprès de **France Compétences**, soutenu par plusieurs acteurs institutionnels du secteur.
- Rédaction d'une **note d'opportunité sur l'impact du Green** (marché du travail, entreprises, enjeux sociétaux), fondée sur **200 études collectées et 40 études analysées en profondeur**.
- Conception du **programme pédagogique et compétences clés** structuré en six séquences : introduction, rapports clés, scoring & rating, institutions & régulations, labels, financements & méthodologies Risk.
- Création des **supports de formation multimédias** : PDF, vidéos, audios et contenus interactifs.
- Mise en œuvre et **tests de la plateforme de formation**, garantissant l'ergonomie, la fiabilité et la conformité réglementaire.

- Exercice d'un **mandat d'administrateur** au sein de la **CNCEF (Chambre Nationale des Conseils Experts Financiers)**, contribuant à la gouvernance, la supervision et la représentation de la profession des Conseillers en Investissement Financier (CIF).
- Participation active à la **définition et à la mise en œuvre de la stratégie nationale** de la CNCEF, en cohérence avec les orientations réglementaires de l'AMF et les attentes du secteur.
- Élaboration des **objectifs stratégiques et opérationnels** de la Chambre, incluant la promotion de la transparence, de la conformité et de la déontologie au sein de la profession.
- Contribution à la **gouvernance financière** : approbation des budgets, plans d'actions, projets de développement et axes de communication institutionnelle.
- **Supervision des politiques de conformité et d'éthique**, notamment sur les obligations MIFID II, DDA, LCB-FT et ESG, pour garantir l'alignement avec les standards européens.
- Veille à la **bonne application des réglementations en vigueur**, à la conformité des pratiques et à la protection des investisseurs.
- Exercice d'une **fonction de contrôle et d'évaluation** de la performance et de la gouvernance interne, en s'assurant de la bonne utilisation des ressources et du respect des engagements.
- **Participation aux comités spécialisés** (éthique, innovation, formation, digitalisation) pour renforcer les dispositifs de contrôle et de développement du secteur financier.
- Contribution à la **stratégie de communication institutionnelle**, visant à renforcer la visibilité et la crédibilité de la CNCEF auprès des acteurs publics et privés.
- **Représentation officielle de la CNCEF** auprès des autorités réglementaires (AMF, ACPR), des ministères, des institutions financières et des associations professionnelles.
- **Soutien à la transformation du métier de CIF**, notamment sur les enjeux de digitalisation, d'éthique et de finance durable (ESG, Green Finance, impact investing).
- **Relais des préoccupations et besoins des adhérents**, en favorisant le dialogue entre les membres, les instances dirigeantes et les régulateurs.
- Participation à la **veille stratégique sur les évolutions réglementaires européennes** (MIFID III, CSRD, SFDR, DORA) et à la diffusion d'analyses auprès des membres.
- Soutien à la **démocratisation de la finance verte et responsable** au sein du conseil, en intégrant les critères ESG dans les réflexions stratégiques de la Chambre.

- Enseignement du **Risk Management** auprès de quatre classes en Master et MBA Finance (4<sup>e</sup> et 5<sup>e</sup> années), sur l'ensemble des volets théoriques et pratiques de la gestion des risques financiers.
- Élaboration et animation du **programme pédagogique** couvrant les fondamentaux du risque, les évolutions réglementaires et les applications en environnement bancaire.
- Présentation des **définitions, typologies et fiches de poste** liées aux fonctions Risk, Compliance, Audit et Contrôle Interne.
- Introduction aux **différents types de risques** : Market Risk, Credit Risk, Liquidity Risk, Operational Risk, Reputational Risk, ESG Risk.
- Formation aux **principales réglementations prudentielles** : Bâle II / III, CRD IV, CRR, IFRS9, Solvency II, et directives européennes.
- Décryptage de l'**évolution historique du cadre réglementaire**, du risque bancaire post-2008 à l'intégration des critères ESG.
- Conception d'une **méthodologie d'analyse et d'évaluation du risque**, structurée en étapes claires (identification, mesure, surveillance, mitigation).
- Initiation aux **outils et techniques de Risk Management** : Value at Risk (VaR), Stress Test, Sensitivity Analysis, Expected Shortfall, Backtesting.
- Explication du **cycle complet du Risk Assessment** et des interactions entre FO, MO et BO dans la gestion du risque quotidien.
- Démonstration de **modèles de mesure du risque de crédit et de marché**, incluant PnL monitoring, Credit Exposure et concentration sectorielle.
- Introduction à la **cartographie des risques** et à la construction de plans de contrôle et d'alerte (KRI – Key Risk Indicators).
- Formation à la **lecture et à l'interprétation des rapports Risk & Compliance**, avec des études de cas concrets d'établissements financiers.
- Intégration de **cas pratiques de gestion de crise** : risque systémique, défauts de contrepartie, erreurs opérationnelles, cyber risk.
- Transmission des **bonnes pratiques de gouvernance** : rôle des comités de risque, interaction avec les régulateurs, principes de reporting.
- Développement des **compétences d'analyse critique** et d'approche quantitative appliquée aux risques financiers.
- Sensibilisation à la **dimension comportementale et psychologique du risque**, notamment dans les décisions d'investissement et la gestion de portefeuille.
- Mise en perspective de la **transition vers le Risk ESG**, et de la place du développement durable dans la gestion du risque global.
- Encadrement de **projets étudiants et simulations de comités de risque**, favorisant la mise en pratique des concepts et la rigueur professionnelle.
- Promotion d'une approche **pédagogique interactive et pragmatique**, alliant théorie, cas concrets et retours d'expérience issus du terrain financier.

- Analyse des **risques, du PnL et des expositions globales (Credit Exposure)** sur l'ensemble des activités financières du groupe BNP Paribas, en coordination avec les pôles FO, MO, BO, Comptabilité (CG) et IT.
- Supervision du **processus de reporting consolidé au CFO**, garantissant la cohérence, la fiabilité et la traçabilité des données financières et de gestion des risques.
- Rédaction des **expressions de besoins fonctionnels** et des **objectifs de projet** pour les évolutions des outils et des processus financiers.
- Participation active à la **gestion de projets Agile / Lean Six Sigma**, incluant la coordination, la priorisation et le suivi des sprints d'implémentation.
- Pilotage des **évolutions et migrations des outils de booking** (Power, Murex, Calypso), utilisés pour le suivi des opérations de marché et des transactions structurées.
- Gestion des **outils financiers de consolidation et de correction de données** (Maestro, Hera, Coda) pour améliorer la qualité et la centralisation des informations.
- Définition des **timelines, étapes de projet, acteurs impliqués et deadlines** pour assurer le respect des jalons de livraison.
- Conception et mise en place d'**indicateurs de performance et de suivi (KPI / KRI)** pour le pilotage du Risk et du PnL.
- Collaboration étroite avec les équipes IT pour la **demande, le développement et le suivi des évolutions applicatives**.
- **Encadrement et répartition du travail** entre les équipes locales et offshores, garantissant la continuité et la qualité des livrables.
- Contrôle de **cohérence et de complétude des données** lors des phases de migration et de recette utilisateurs.
- **Centralisation des flux de données interservices** (FO, MO, BO, CG, IT) pour uniformiser la structure des reportings financiers et Risk.
- Suivi du **booking des opérations de marché** et coordination des demandes de correction auprès des services concernés.
- Production du **reporting transversal FO / CG / IT**, consolidé pour la direction financière et le contrôle de gestion.
- Exécution des **réconciliations PnL, valorisations, flux, cash et risques**, avec identification et explication des écarts significatifs.
- Analyse des **volumétries et des évolutions opérationnelles**, pour anticiper les impacts financiers et réglementaires.
- Supervision du **projet de migration du service comptable UK vers l'Inde**, incluant la coordination du transfert de compétences et le suivi qualité.
- Réalisation d'**audits internes transverses** (FO, MO, BO, CG, IT) pour évaluer la conformité et l'efficacité des contrôles existants.
- Pilotage global des **projets de migration, d'évolution et d'optimisation des process**, dans une logique de performance, de fiabilité et de maîtrise du risque opérationnel.



- Création et **mise en place d'un nouveau département "Pôle Service Client"**, interface stratégique entre le **Risk Management**, le **Front Office (Traders, Structurers, Sales)** et les clients institutionnels.
- **Analyse des problématiques de communication** et d'échange d'informations entre Clients, Sales et Structurers pour fluidifier les circuits de validation et de décision.
- **Définition du workflow complet du département** : chronologie, étapes clés, responsabilités des acteurs, délais, livrables et circuits de validation.
- **Étude des besoins métiers** sur les opérations d'achat et de vente de produits structurés (couverture, spéculation, arbitrage).
- Conception et **développement d'un outil automatisé sous Excel/VBA** pour le passage et la traçabilité des ordres, assurant la retranscription automatique selon les métiers (Sales, Structuring, Client).
- **Paramétrage des produits dérivés** et intégration des variables de pricing : Type, Cours, Strike, Taux, Temps, Volatilité, Delta, Gamma, Vega, Thêta, Rhô.
- Contribution à la **conception et à la validation du modèle VaR (Value at Risk)**, en collaboration avec les équipes Risk Quant et Market Risk.
- **Mise à jour régulière des stratégies** de couverture dans les outils de suivi pour garantir la cohérence avec les expositions réelles.
- Réalisation d'une **veille VaR et Risk Metrics**, assurant la pertinence des modèles face à la volatilité de marché.
- Définition des **priorités stratégiques**, recommandations techniques et élaboration de **plans d'action** correctifs.
- **Reporting consolidé au CFO**, incluant la synthèse des analyses de risque, VaR et suivi des indicateurs réglementaires Bâle II/III.
- Supervision du **booking des opérations de marché** et contrôle de cohérence entre les systèmes (FO/MO/BO).
- **Production de reportings Risk et PnL**, intégrant la valorisation des positions, les sensibilités et les stress tests.
- Extraction et retraitement des données issues de **Kondor** pour la valorisation et la gestion des positions de marché.
- **Production de synthèses analytiques** pour les comités de direction et les comités de risque.
- Réalisation de **contrôles réglementaires et conformité opérationnelle** sur les activités structurées.
- **Rédaction des documentations utilisateurs, procédures et manuels opérationnels** pour la bonne utilisation des outils et le respect des process.
- Développement et **mise en place d'un pricer interne** pour les produits structurés (ZC + LVA, couvertures et stratégies complexes).
- Formalisation et **retranscription des principales stratégies de structuration de couverture**, incluant : Long/Short Call & Put, Straddle, Strangle, Tunnel, Spread, Butterfly, CAP/FLOOR KO/KI, etc.
- **Optimisation du pilotage du risque et du service client**, en renforçant la coordination entre les équipes techniques, commerciales et risk management pour améliorer la qualité et la réactivité opérationnelle.

- **Support opérationnel au desk de structuration Fonds de Fonds**, en accompagnant les structurers dans l'analyse, la sélection, la structuration et le reporting des portefeuilles.
- Rédaction des **expressions de besoins et objectifs fonctionnels**, en coordination avec les équipes Structuring, Compliance et Risk Management.
- **Analyse des besoins métiers** de l'équipe de structuration pour optimiser les workflows de sélection et de suivi des fonds.
- **Structuration et modélisation de hedge funds et fonds de fonds**, en intégrant les contraintes de risque, liquidité, diversification et performance.
- Utilisation et administration de l'outil **Pertrac**, dédié à l'analyse quantitative et qualitative des fonds (data, performance, ratios).
- **Création et gestion d'une base de données Pertrac**, centralisant les positions, historiques de performance et documents légaux des fonds.
- **Analyse et sélection des fonds sous-jacents**, en fonction de critères financiers, ESG et de due diligence opérationnelle.
- **Back-testing et simulation** de performance sur produits structurés et stratégies multi-fonds.
- Rédaction des **propositions de structuration** et demandes de validation interne (structurers, compliance, risk).
- Conception d'**indicateurs financiers standards et personnalisés** pour les équipes Structuring, Risk et Compliance.
- **Vérification et validation des données de fonds**, cohérence des ratios, benchmark et indicateurs de performance.
- **Alimentation, contrôle et maintenance des flux d'information** dans Pertrac pour garantir la fiabilité des analyses.
- Traitement et **résolution des anomalies de l'outil Pertrac**, en lien avec les équipes IT et support applicatif.
- **Reporting régulier** des analyses de performance, de risque et de structure des fonds auprès du management et des structurers.
- Production de **présentations commerciales et études synthétiques**, à destination des clients internes et externes.
- **Participation aux réunions de structuration**, apport d'analyse quantitative pour la définition des produits et des stratégies.
- **Recommandation et priorisation des actions correctives**, avec élaboration de plans d'action précis.
- Assistance à la **recherche de fonds alternatifs innovants**, intégrant des stratégies long/short, arbitrage, macro ou ESG.
- **Support fonctionnel expert de Pertrac** auprès des Structurers, Risk Managers et équipes Compliance pour la bonne exploitation de l'outil.
- Suivi des **incidents techniques et opérationnels**, coordination entre les équipes FO/MO et IT pour assurer la continuité d'activité et la qualité du reporting.

- **Création et mise en place d'un nouveau service de Middle Office**, dédié à la gestion et au suivi opérationnel de 19 fonds institutionnels multi-classes d'actifs.
- **Audit initial des processus existants**, identification des points de défaillance et des dysfonctionnements opérationnels affectant la production et le reporting.
- **Analyse complète du cycle de vie des opérations** (Trade Lifecycle) pour optimiser la coordination entre le Front Office, le Middle Office et le Back Office.
- **Revue et validation des transactions** : contrôle des deals, vérification des positions, rapprochement des cash flows et validation des confirmations.
- **Mise en place de contrôles de cohérence** entre les données de marché, les positions comptables et les expositions (Credit Exposure, Counterparty Risk).
- **Standardisation des procédures MO**, définition des workflows, matrices de responsabilité et SLA (Service Level Agreements) avec les équipes FO/BO.
- Conception d'un **plan de remédiation** pour corriger les anomalies identifiées dans les systèmes de gestion de positions et de valorisation.
- **Reconciliation quotidienne des positions et valorisations (PnL, NAV, Cash)** avec les dépositaires et les administrateurs de fonds.
- **Définition des indicateurs clés de suivi (KPI/KRI)** pour le pilotage des risques opérationnels et la performance du MO.
- **Automatisation des contrôles et du reporting** via outils Excel VBA, pour fiabiliser et accélérer la production.
- Coordination avec les équipes IT pour la **mise à jour des systèmes de gestion de portefeuille (PMS) et outils de valorisation**.
- **Pilotage du déploiement du nouveau Middle Office**, formation des équipes et transfert de compétences sur les nouvelles procédures.
- **Production des reportings opérationnels** destinés à la direction financière, au Risk Management et aux clients institutionnels.
- **Analyse des écarts de valorisation (PnL reconciliation)** et mise en place d'un processus de validation en cas de différences significatives.
- **Contrôle de conformité réglementaire** sur les opérations et les reportings (UCITS, AIFM, ESG disclosures).
- **Communication transverse** avec les départements FO/MO/BO pour fluidifier la chaîne de traitement et réduire les délais de validation.
- Élaboration et **documentation des procédures opérationnelles**, garantissant la conformité, la traçabilité et la robustesse du dispositif MO.
- **Optimisation continue du dispositif de contrôle**, visant à renforcer la qualité, la réactivité et la fiabilité du Middle Office institutionnel.
- **Reporting final au management et aux auditeurs externes**, démontrant la mise en conformité, la fiabilité et la stabilité du nouveau dispositif de Middle Office.