|  |  |
| --- | --- |
| Logo of the European Commission, 12 yellow stars on a blue background arranged in a circle and framed by two light grey graphic elements representing the Berlaymont building, which is the headquarter of the European Commission. | COMMISSION EUROPÉENNE |

AVIS DE VACANCE POUR UN POSTE D’EXPERT NATIONAL DÉTACHÉ

|  |  |
| --- | --- |
| DG – Direction – Unité | Direction générale du budget — Unité du directeur des risques |
| Numéro de poste Sysper: | Cliquer ou toucher ici pour introduire le texte. |
| Personne de contact:  Prise de fonctions souhaitée:  Durée initiale:  Lieu de détachement: | Iliyana TSANOVA  T2 trimestre 2025  1 année  Bruxelles  Luxembourg  Autre: Click or tap here to enter text. |
| Type de détachement |  |
| Cet avis de vacance est ouvert aux:    ainsi qu’aux  pays AELE suivants:  Islande  Liechtenstein  Norvège  Suisse  pays tiers suivants: …  organisations intergouvernementales suivantes: … | |
| Délai des candidatures | Date limite pour postuler: 25-04-2025 |

**Présentation de l’entité (nous sommes)**

Le directeur des risques est une fonction indépendante, qui supervise les risques financiers liés aux opérations financières de l’Union, tels que les opérations d’emprunt et de gestion de la dette, les actifs faisant l’objet d’opérations de gestion, les opérations de prêt et les garanties budgétaires. La fonction de directeur des risques a été initialement créée le 14 avril 2021 pour les opérations d’emprunt, de gestion de la dette et de prêt au titre de NextGenerationEU. La supervision du directeur des risques a ensuite été étendue à toutes les opérations financières de l’UE.

Les opérations financières de l’Union ont considérablement augmenté — en termes de volume et de portée — au cours de l’actuel cadre financier pluriannuel. Les prêts, les garanties budgétaires et le financement des politiques de l’UE par l’émission de titres de créance ont été utilisés à grande échelle pour financer les réponses aux défis émergents et aux crises successives. La mise en œuvre de ces opérations financières peut exposer l’Union à divers risques financiers — y compris en matière de crédit, de marché, de liquidité, d’exploitation, de réputation, de conformité et de conformité — qui pourraient avoir des incidences sur le budget de l’Union. Les risques financiers découlant de l’exécution des opérations financières de l’Union devraient être correctement identifiés, atténués, gérés et notifiés. Le cadre en matière de risques devrait être solide et fournir une capacité complète, rigoureuse et indépendante de surveillance des risques financiers qui surviennent dans toutes les opérations financières de l’Union entreprises. Ce cadre devrait garantir que les opérations financières de l’Union soient menées dans le respect des normes les plus élevées en matière d’intégrité et de bonne gestion financière et des risques.

La Commission a chargé le directeur des risques, en tant que deuxième ligne de défense, d’élaborer et de mettre en œuvre le cadre de gestion des risques de la Commission (ci-après le «cadre»). Soutenu par une unité de gestion des risques, le directeur des risques est chargé d’assurer une gouvernance solide, une gestion efficace des risques et une surveillance globale des risques financiers associés aux opérations financières de l’Union. Le directeur des risques travaille en étroite coopération avec les directions générales chargées des opérations financières de l’Union, agissant en tant que première ligne de défense. Le directeur des risques et de la conformité préside le comité du risque et de la conformité, qui l’assiste dans l’élaboration du cadre des risques et de la gestion des risques financiers découlant des opérations financières de l’Union.

La fonction de CRO est hébergée par la direction générale du budget (DG BUDG), qui est le service central de la Commission européenne chargé de la préparation et de l’exécution du budget annuel et pluriannuel de l’Union européenne. Il compte environ 600 personnes et se compose de sept directions basées à Bruxelles et à Luxembourg. Les membres du personnel sont originaires de tous les pays de l’UE et possèdent diverses compétences professionnelles: comptabilité, économie, finance, affaires, programmation, audit, droit, communication, ressources humaines, administration européenne et autres domaines.

**Présentation du poste (nous proposons)**

L’équipe CRO cherche à engager un gestionnaire des risques quantitatifs afin d’élaborer, de mettre en œuvre et de maintenir un modèle de risque de crédit utilisé pour quantifier les pertes potentielles résultant des prêts aux pays tiers et des garanties budgétaires. En tant que deuxième ligne de défense, le candidat retenu devrait collaborer avec ses collègues de l’unité ainsi qu’avec les directions générales chargées des opérations financières de l’Union, agissant en tant que première ligne de défense. Ses tâches seront principalement axées sur:

* Élaborer un modèle de risque de crédit fondé sur le mérite pour prévoir la valeur en risque (VaR) pour l’ensemble des portefeuilles de garanties et de prêts,
* Mettre en œuvre des configurations en plusieurs étapes et en une seule étape pour évaluer les différences entre les mesures de risque,
* Mettre au point des méthodes d’évaluation de la qualité des données d’entrée et des paramètres de risque afin de garantir un calibrage adéquat du modèle,
* Effectuer des contrôles et des validations a posteriori afin de garantir la précision et la robustesse du modèle,
* Documenter le modèle et intégrer la méthodologie dans la politique de gestion des risques,

Mettre en œuvre le modèle à l’appui des avis des ORC sur les propositions de nouveaux programmes de la première ligne de défense pour un soutien financier et/ou des garanties budgétaires.

**Profil du titulaire (nous recherchons)**

Le candidat idéal disposera d’une expertise dans le domaine de la finance quantitative, de la modélisation des risques, des processus stochastiques et de l’évaluation des risques de portefeuille**,** avec une solide expérience en mathématiques et en programmation financières.

**Compétences techniques requises:**

* Une bonne connaissance des modèles de risque de crédit, en particulier du modèle Merton et de ses variations,

1. Expertise en matière de modélisation de la valeur en risque (VaR) et d’analyse des risques liés au portefeuille de crédit,

* Maîtrise de la théorie des probabilités, des procédés stochastiques et des techniques de simulation Monte Carlo,
* Expérience en matière de modélisation de séries chronologiques et d’économétrie financière (par exemple copulas),

1. Solides compétences en programmation à Python; Java est considéré comme un avantage supplémentaire,

* Expérience de la manipulation de données, de l’analyse des risques et des techniques d’apprentissage automatique pour la modélisation financière.

**Connaissances financières et réglementaires:**

* Connaissance des cadres réglementaires, en particulier Bâle, IFRS, guide de la BCE sur les modèles internes, etc.
* Première expérience du processus de validation des modèles.

**Compétences professionnelles en matière d’analyse:**

* Une expérience antérieure dans une banque d’investissement, une banque de développement, une institution financière, une société de conseil en risques ou une agence de réglementation,
* Expérience avérée dans l’élaboration et la mise en œuvre d’un modèle de risque de crédit,
* Posséder de solides aptitudes quantitatives et analytiques en accordant une attention particulière aux détails,
* Expérience du travail avec de grands ensembles de données, des indicateurs de risque et des outils de modélisation financière,
* Capacité à discuter et à argumenter avec la première ligne de défense afin de parvenir à un consensus sur les choix méthodologiques,
* Capacité à communiquer les résultats techniques à l’encadrement supérieur,
* Solides compétences en matière de résolution de problèmes et aptitude à travailler de manière autonome.

**Qualifications requises:**

* Diplôme universitaire en finance quantitative, ingénierie financière, mathématiques, statistiques, économie, ou dans un domaine connexe,
* Les certifications professionnelles telles que FRM (gestionnaire des risques financiers), CFA et PRMIA (gestionnaire professionnel des risques) sont un atout.

**Critères d’éligibilité**

Le détachement sera régi par la **décision de la Commission C(2008) 6866** du 12/11/2008 relative au régime applicable aux experts nationaux détachés et aux experts nationaux en formation professionnelle auprès des services de la Commission (décision END).

Aux termes de la décision END, vous devrez obligatoirement remplir les critères d’éligibilité suivants **à la date de début du détachement** :

Expérience professionnelle : posséder une expérience professionnelle d’au moins trois ans dans des fonctions administratives, judiciaires, scientifiques, techniques, de conseil ou de supervision, à un grade équivalant au groupe de fonctions administrateur AD;

Ancienneté de service : avoir une ancienneté d’au moins un an (12 mois) auprès de votre employeur actuel, dans un cadre statutaire ou contractuel;

Employeur : être employé par une administration publique nationale, régionale ou locale, ou par une organisation intergouvernementale (OIG); exceptionnellement et après dérogation, la Commission peut accepter des candidatures lorsque votre employeur est un organisme du secteur public (e.g. agence ou institut de régularisation), une université ou un organisme de recherche indépendant.

Compétences linguistiques : avoir une connaissance approfondie d’une des langues de l’Union européenne et une connaissance satisfaisante d’une autre langue de l’Union européenne dans la mesure nécessaire aux fonctions qu’il est appelé à exercer. Si vous venez d’un pays tiers, vous devrez justifier posséder une connaissance approfondie de la langue de l’Union européenne nécessaire à l’accomplissement des tâches qui vous seront confiées.

**Conditions du détachement**

Durant toute la durée de votre détachement, vous devrez rester employé et rémunéré par votre employeur et devrez également rester couvert par votre sécurité sociale (nationale).

Vous exercerez vos fonctions au sein de la Commission dans les conditions fixées par la décision END précitée et serez soumis(e) aux règles de confidentialité, de loyauté et d’absence de conflit d’intérêts qui y sont définies.

Dans le cas où le poste est publié avec indemnités de séjour, celles-ci ne vous seront octroyées que si vous remplissez les conditions prévues à l’article 17 de la décision END.

Le personnel en poste dans une délégation de l’Union européenne doit obligatoirement disposer d’une habilitation de sécurité (jusqu’au niveau SECRET UE/EU SECRET conformément [à la décision de la Commission (EU – Euratom) 2015/444 du 13 mars 2015](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/FR/TXT/?uri=CELEX:32015D0444). Il vous appartient de lancer cette procédure d’habilitation de sécurité avant d’obtenir la confirmation de votre détachement.

**Soumission des candidatures et procédure de sélection**

Si vous êtes intéressé, veuillez suivre les instructions données par votre employeur pour postuler.

La Commission Européenne **acceptera seulement les candidatures qui auront été soumises par l’intermédiaire de la Représentation Permanente / Mission Diplomatique de votre pays auprès de UE, le secrétariat de l’AELE (EFTA) ou par le(s) canal (canaux) qui aura (auront) été spécifiquement convenu(s)**. Les candidatures reçues directement de votre part ou de votre employeur ne seront pas prises en considération.

Vous devez envoyer votre candidaturesous format **CV Europass** ([Créez votre CV Europass | Europass](https://europa.eu/europass/fr/create-your-europass-cv))en français, anglais ou allemand.Votre CV doit obligatoirement mentionner votre nationalité.

Veuillez ne pas ajouter d’autres documents(tels que copie de carte d’identité, copie des diplômes ou attestation d’expérience professionnelle, etc.). Le cas échéant, ces documents vous seront demandés ultérieurement.

**Traitement des données à caractère personnel**

La Commission européenne veillera à ce que les données à caractère personnel des candidats soient traitées dans le plein respect du règlement (UE) 2018/1725 du Parlement européen et du Conseil ([[1]](#footnote-1)). Ces dispositions s’appliquent en particulier à la confidentialité et à la sécurité de ces données. Avant de postuler, veuillez lire la déclaration de confidentialité.

1. () Règlement (UE) 2018/1725 du Parlement européen et du Conseil du 23 octobre 2018 relatif à la protection des personnes physiques à l’égard du traitement des données à caractère personnel par les institutions, organes et organismes de l’Union et à la libre circulation de ces données, et abrogeant le règlement (CE) nº 45/2001 et la décision nº 1247/2002/CE (JO L 295 du 21.11.2018, p. 39). [↑](#footnote-ref-1)