

Mehdi Bonnet

Analyste Risques Junior



Paris, France · mehdi.bonnet@gmail.com · +33 6 93 41 58 27 · linkedin.com/in/mehdibonnet

Diplômé du Master Risques Financiers à l'ENSAE ParisTech avec 6 mois de stage chez Société Générale CIB. Modélisation des risques de marché sur un portefeuille de **2,5 Mds EUR**. Calcul de VaR et stress tests sur **8 classes d'actifs**. Développement de **3 modèles Python** d'analyse de risque validés par la direction. Maîtrise de Python, R, Bloomberg et des normes FRTB.

Expérience

Janv. 2025 – Juin 2025

Stagiaire Analyste Risques de Marché, Société Générale CIB – Direction des Risques, La Défense
Stage de 6 mois au sein de l'équipe risques de marché.

- Calcul quotidien de la VaR et des sensibilités sur un portefeuille de **2,5 Mds EUR**
- Réalisation de **15 stress tests** réglementaires et historiques sur **8 classes d'actifs**
- Développement de **3 modèles Python** d'analyse de risque (backtesting, scenario analysis)
- Rédaction de **10 rapports** de risque pour le comité ALCO

Sept. 2023 – Août 2024

Assistant Analyste Quantitatif (Alternance), Natixis – Département Modèles, Paris
Alternance de 12 mois au sein de l'équipe de validation des modèles.

- Validation de **4 modèles** de pricing d'options (Monte Carlo, Black-Scholes)
- Développement de **2 outils de backtesting** en Python
- Rédaction de **6 rapports** de validation de modèles pour le régulateur

Formation

Sept. 2023 – Juil. 2025

Diplôme et spécialité, ENSAE ParisTech, Palaiseau
Diplômé avec mention Bien. Alternance Natixis.

- Mémoire : « Backtesting de la VaR Expected Shortfall sous FRTB », noté **17/20**
- Modules : Modèles stochastiques, Gestion des risques, Machine Learning, Calcul haute performance

Compétences

Risque de marché (VaR, ES, sensibilités), Python (NumPy, Pandas, SciPy), R (analyse statistique), Bloomberg Terminal, Stress testing réglementaire, Normes FRTB / Bâle III, Modèles stochastiques, Backtesting, Excel VBA, Rédaction de rapports de risque

Certifications

Mai 2025 – Mai 2025

FRM Part I – Financial Risk Manager, GARP

Langues

Français (langue maternelle), Anglais (C1), Arabe (B1)

Projets

Sept. 2024 – Mars 2025

Modèle de backtesting VaR – ENSAE ParisTech

Développement d'un framework de backtesting pour la VaR et l'Expected Shortfall.

- Implémentation de **5 tests statistiques** (Kupiec, Christoffersen, Berkowitz, etc.)
- Application sur **3 ans** de données historiques (S&P 500, Euro Stoxx 50, CAC 40)
- Résultats présentés à un panel de **3 professionnels** de la gestion des risques

Références

Thomas Roussel, Head of Market Risk, Société Générale CIB, t.roussel@socgen.com, +33 1 42 14 67 30

Activité extra-scolaire

Sept. 2023 – Juin 2025

Membre – ENSAE Finance Club

Participation au club finance de l'ENSAE (60 membres).

- Organisation de **4 conférences** sur la gestion des risques avec des professionnels
- Simulation de gestion de portefeuille : rendement de **+8 %** sur 6 mois