



Philippe Lacombe 36 ans - 11 ans d'expérience professionnelle

✉ philippe@hiram-finance.com ☎ + 33 1 42 66 25 25



Missions réalisées/suivies

Depuis mars 2005 :

Grande Banque de la Place de Paris.

- Organisation d'une chaîne de résultat FO-to-Comptabilité (organisation, communication interne, process, procédures) et spécifications des évolutions de systèmes induites
- Coordination des choix de changements de systèmes FO/BO sur les dérivés de crédits et dérivés de taux
- Mise en place des IFRS : FTA, spécifications des modifications de systèmes et de process (DayOne P/L, valorisation des émissions, adossements)
- Définition du SI cible d'une filiale spécialisée
- Aide à la mise en place d'une Joint Venture entre lignes métiers sur opérations hybrides.
- Redéfinition et mise en œuvre des outils et méthodes de publication de valorisations

Depuis février 2004 :

Grande Banque de la Place de Paris.

- Mise en place d'une méthode de prise en compte des courbes (pentas) de spreads de crédit et des corrélations dans le calcul de la VaR sur les dérivés de crédit, traitements des trous et asynchronismes dans les sources de données
- Maîtrise d'ouvrage méthodologique sur les mesures de risques sur dérivés de crédit complexes et risques de base
- Définition des stress scénarios sur les dérivés de crédit
- Définition des principes de nettoyage et de migration de 1,500 montages structurés (tous sous-jacents)

Juillet 03 – décembre 03 :

Banque supranationale

- Redéfinition des process de la trésorerie autour de Summit

mars 03 - décembre 04 :

Grande Banque de la Place de Paris et Filiale d'une Grande Banque de Paris.

- Reprise des émissions et de leurs couvertures afin d'assurer la valorisation Marked-to-Market des opérations
- Audit et préconisations sur les systèmes et l'organisation sur plusieurs activités complexes : Funds&Vehicles, CPPI
- ALM : conception et mise en place d'une organisation de suivi des marges commerciales et de gestion de la trésorerie
- Reprise du spread book d'une grande banque (audit du portefeuille et remodelisation)

janvier 02 - janvier 03 :

Grande Banque de la Place de Paris. Reprise des opérations de Dérivés de taux d'une grande banque. Migration de systèmes FO et BO, détermination de la soule de cession du portefeuille de trading et de la valorisation comptable d'ouverture de l'ensemble des opérations.

mai - septembre 02 :

Grande Banque de la Place de Paris. Mise en place de la VaR « dérivés de Crédit ».

février 01 - janvier 02 :

Grande Banque de la Place de Paris. Travaux pour fiabiliser la production de la VaR sur les produits exotiques de taux et spécification puis gestion de projet d'un outil d'analyse de la VaR et des résultats quotidiens.

octobre 00 - janvier 01 :

Grande Banque de la Place de Paris. Spécifications et réalisation d'un outil de réconciliation de stock et de valorisation dans le cadre de contrats de collatéralisation sur produits dérivés.

juin - août 2000 :

Grande Banque de la Place de Paris. Spécification et réalisation d'un outil de suivi (résultat coure, MtM, sensibilités, gap, simulation position et taux) des positions de trésorerie.



Expérience professionnelle

Depuis juin 2000 :

Hiram Finance.

- Responsable de la ligne métier Risk Management et ALM bancaire (missions & méthodologie)
- Responsable du projet simulation Long Terme de scénarios globaux de marchés (méthodes Monte-Carlo et hybrides)
- Chargé de cours « théorie de la finance », HEC

septembre 1999 - mai 2000 : **Consultant indépendant.**

- Formation en finance de marchés, principaux clients : CPR, BNP-Paribas, CAI, Consorts
- Chargé de cours en Grandes Ecoles en finance et management bancaire : HEC, ESSEC

septembre 1995 - juin 1999 : **Inspecteur de banque, Société Générale.**

Missions incluant automatiquement la revue et la mise à jour des mesures de risques (contrepartie et marchés) et la redéfinition des provisions pour risques et créances compromises des entités opérationnelles auditées.

- Missions inspecteur confirmé : Exotiques taux et actions, rémunérations variables (branche internationale et finance)
- Missions inspecteur adjoint : salle « marchés émergents », refonte du système d'information marketing retail
- Missions inspecteur auxiliaire : salle « Commodities », Agence Centrale, sécurité du réseau informatique du siège

juillet 1992 - août 1994 :

Quants.

- Développements de modèles de valorisation de produits dérivés sur taux standards et exotiques sur modèles (CL)
- Développement d'un modèle de valorisation et de modèle micro-économique sur taux et crédit (BNP)



Formation

1994 :

Ancien élève de l'**Ecole Normale Supérieure de Cachan** section Mathématiques.

1993 :

Diplômé de l'**Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economique.**

Troisième cycle « modélisation mathématique en économie » Paris I – Ecole Polytechnique.

Langues :

Français (langue maternelle). Anglais : courant

Hiram Finance – France – 25, rue d'Astorg 75 008 Paris

tél : +33 (0)1 42 66 25 25 – fax : +33 (0)1 42 66 25 00 - www.hiram-finance.com

SARL au capital de 100 000 EUR - N° de R.C.S. de Paris : B 420 711 996