
65 rue du Javelot, 75 013 Paris, France
+33 6 73 00 54 78

mathieu.perona@nsup.org
<https://fr.linkedin.com/in/perona>

Compétences clef

Data Science	Statistiques paramétriques et robustes, économétrie, séries temporelles Data visualisation
Gestion des risques	Identification et modélisation des risques, stress-testing Mesure de l'appétit au risque, gestion du risque de modèle
Recherche	Conduite de projets de recherche fondamentale et appliquée, gestion d'une équipe de R&D
Communication	Communication sur des sujets techniques et complexes en direction d'un ensemble diversifié de parties prenantes
Économie	Politique de la concurrence, modélisation par agents, théorie des contrats

Expérience

- Société Générale**, Direction des risques, Département de suivi transversal des risques
Responsable d'équipe méthode de pilotage (2014 –)
- Développement du cadre anticipatif du risque de crédit
 - Redéveloppement complet des modèles économétriques de prédiction du défaut de paiement
 - Définition d'un dispositif Groupe de modélisation économétrique et du risque de modèle associé
 - Dispositif global d'appétit au risque : description, évaluation et évolution du dispositif pour les risques de crédit, de marché et opérationnel, intégration des risques émergents
 - Coordination Risques des stress-tests Groupe
 - Point de contact lors d'inspections sur site de régulateurs
 - Gestion d'une équipe de R&D de collaborateurs autonomes de qualifiés (ingénieurs et docteurs)
- Analyste quantitatif** (2011 – 2014)
- Définition du cadre méthodologique Groupe pour les stress crédit
 - Modélisation du risque de crédit : modèles économétriques du défaut, risque de concentration
- Doctorat et post-doctorat** (2005 – 2011)
- Doctorat à l'École d'économie de Paris, Post-doctorat à Sciences-Po Paris
Enseignement à SciencesPo Paris et à Paris 1 Panthéon-Sorbonne
Thèmes Organisation industrielle, politiques de la concurrence, économie des biens culturels

Formation

- | | |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2005 – 2010 | Doctorat en économie
<i>Trois Essais sur les politiques publiques des industries culturelles</i>
École d'économie de Paris, dir. Bernard Caillaud |
| 2002 – 2004 | Master Analyse et Politiques économiques , École d'économie de Paris
Diplôme de statisticien-économiste , ENSAE |
| 2001 – 2005 | École Normale Supérieure (Paris) , concours B/L |

Langues, formations et sport

Langues	anglais (professionnel), japonais (intermédiaire)
Formation	Programme Octave 2015 (management intergénérationnel), Mentor Frateli
Informatioque	Logiciels statistiques (R, SAS), MS Office
Sports	Aikido, 3 nd dan, BEES 1 ^{er} degré
