

---

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

---

<b>Data Science</b>	Statistiques paramétriques et robustes, économétrie, séries temporelles Data visualisation
<b>Gestion des risques</b>	Identification et modélisation des risques, stress-testing Mesure de l'appétit au risque, gestion du risque de modèle
<b>Recherche</b>	Conduite de projets de recherche fondamentale et appliquée, gestion d'une équipe de R&D
<b>Communication</b>	Communication sur des sujets techniques et complexes en direction d'un ensemble diversifié de parties prenantes
<b>Économie</b>	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	<b>Doctorat en économie</b> <i>Trois Essais sur les politiques publiques des industries culturelles</i> École d'économie de Paris, dir. Bernard Caillaud
2002 – 2004	<b>Master Analyse et Politiques économiques</b> , École d'économie de Paris <b>Diplôme de statisticien-économiste</b> , ENSAE
2001 – 2005	<b>École Normale Supérieure (Paris)</b> , 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 <sup>nd</sup> dan, BEES 1 <sup>er</sup> degré

---