

DESCRIPTIF DU STAGE	
Intitulé	Implémentation d'une nouvelle méthodologie de calcul d'un Stress Test de Repo
Date de début du stage	Mars 2014
Durée	6 mois ou plus
Rythme	<input checked="" type="checkbox"/> Temps plein <input type="checkbox"/> Rythme alterné :
Nombre de stagiaire(s)	1
Ville où va se dérouler le stage	Paris – Ile de France
Domaine d'activité du stage	Finance de marché
Environnement	<p>Global Banking and Investment Solutions (GBIS) est la branche de Banque de financement et d'investissement du groupe Société Générale. Elle offre des solutions sur mesure en termes de levée de capitaux, financement, gestion de risque et de placement à ses clients émetteurs et investisseurs sur les marchés de dette et d'actions.</p> <p>Rattaché au département RISQ, vous intégrez l'équipe en charge de la définition des méthodologies de suivi et de l'encadrement des risques de marché sur les Taux.</p>
Activités principales du stagiaire	<p>Le but du stage sera de travailler sur une nouvelle méthodologie de calcul d'un Stress Test de repo. Pour cela, les principales tâches seront:</p> <ul style="list-style-type: none"> -> Participation à la définition de la méthodologie et réalisation de tests de pertinence et de cohérence. -> Implémentation en VBA d'un outil tactique de suivi. -> Analyse des résultats <p>En fonction de la capacité du stagiaire à délivrer, des sujets complémentaires dans le domaine du suivi des risques de taux pourront être envisagés.</p>
Apports du stage	Ce stage vous permettra de découvrir l'environnement de la salle marché et l'environnement Risk.
Niveau d'étude demandé	Bac + 5
Formation souhaitée	<p>Vous êtes étudiant de niveau Bac +5 en École d'ingénieurs type Centrale, Mines/Ponts, ...</p> <p>Vous disposez de bonnes connaissances en mathématiques financières et produits financiers.</p>

PROFIL RECHERCHE	
Connaissance(s) linguistique(s)	Anglais obligatoire
Connaissance(s) informatique(s)	Langage orienté objet indispensable.
Qualités requises	<p>Capacité de travail importante.</p> <p>Capacité d'analyse et de synthèse, autonomie.</p> <p>Sens de l'organisation et pro activité.</p>