



2, rue André Bonin
69316 Lyon cedex 04

STAGE SCOLAIRE

Direction de la Valorisation de l'Energie

Sujet : Calcul des Initial Margin et Variation Margin sur les Futures Electricité

CNR (la Compagnie Nationale du Rhône) est le 1^{er} producteur français d'électricité d'origine 100 % renouvelable (eau, vent, soleil) et le concessionnaire à vocation multiple du Rhône de la frontière suisse à la Méditerranée : production d'hydroélectricité, développement du transport fluvial, agriculture durable et environnement pour un développement durable des territoires. CNR propose ses services en gestion et valorisation des énergies intermittentes et son expertise en ingénierie en France et dans le monde. Elle est un acteur clé de la transition énergétique. Forte de 1370 collaborateurs répartis entre le siège social à Lyon et la vallée du Rhône, CNR a un capital public-privé avec le Groupe Engie en actionnaire de référence.

Domaine d'activité : Marchés financiers

Diplôme et niveau : Ingénieur – bac+5. Ecole d'ingénieur généraliste ou à dominante mathématiques

Durée du stage : 6 mois, à partir de février/mars 2018

Lieu d'exécution du contrat : Lyon 4ème

Eléments de contexte :

La Direction de la Valorisation de l'Energie de la CNR a pour mission, entre autres, de placer la production d'hydroélectricité de la compagnie sur les marchés de l'énergie. Ce placement se fait aux travers de produits standards et de produits structurés. Cette activité sur les marchés est contrôlée par un Middle-Office et un Back-Office. Ces entités opérationnelles sont appuyées par une équipe dédiée (Département Appui Opérationnel et Back Office), dans laquelle évoluera le/la stagiaire.

Participe aux missions et activités :

Parmi les produits traités sur les marchés par la CNR, les contrats Futures génèrent une multitude de flux financiers tant à l'initialisation de la transaction que tout au long de la vie du produit. L'objectif de ce stage est de mettre en place tous les outils qui permettent de contrôler l'ensemble de ces flux financiers générés par ces contrats futures.

En pratique, le stagiaire devra :

- comprendre le fonctionnement de ces contrats
- recenser l'ensemble des flux financiers générés
- pour chacun de ces flux, mettre en place l'algorithme qui permette, en interne CNR, de les recalculer
- créer un outil de réconciliation entre la vision CNR de ces flux et les flux financiers réellement réalisés sur les compte de la CNR

Profil recherché :

Issu d'une formation d'ingénieur généraliste ou à dominante mathématiques, le/la stagiaire aura un bagage mathématiques/statistiques solide, notamment sur les sujets de finance de marché. Doté(e) d'un esprit critique, il/elle fera preuve de rigueur, et devra travailler en autonomie.



Un bon relationnel, un esprit d'initiative, et un goût prononcé pour le travail en équipe seront des qualités fortement appréciées.

Contact : j.nicolas@cnr.tm.fr

Si vous êtes intéressés par cette offre de stage, merci de postuler directement sur notre site internet www.cnr.tm.fr, dans l'onglet «Carrières et RH » puis « alternance/stage». Référence