



# BNP PARIBAS

**Mission de l'équipe dans laquelle le/la stagiaire sera intégré(e) (Risk- ALMT&L Models):**

La mission de l'équipe est de revoir, challenger et valider les modèles et les indicateurs ALM relatifs aux risques de taux et de liquidité. L'équipe travaille en étroite collaboration avec les Métiers ainsi qu'avec les autres équipes de la fonction risque.

**Contexte et enjeu(x) du stage :**

Dans le cadre du suivi de la gestion des risques de taux et de liquidité du Groupe, l'analyste doit réfléchir à la conception de modèles comportementaux alternatifs (pour modéliser certains produits proposés par la banque de détail : Plan épargne logement...) . L'analyste doit également concevoir un outil et/ou des contrôles afin de s'assurer de la bonne implémentation des modèles comportementaux (de remboursement anticipés, de PEL) dans les indicateurs du risque de taux de l'ALM. L'outil/Contrôle s'appuiera sur des simulations de Monte Carlo et sur des modèles comportementaux développés en interne.

Le stage permettra de :

- développer ses connaissances des produits bancaires (surtout Retail)
- découvrir la gestion ALM (risque structurel de taux et risque de liquidité).
- approfondir les connaissances techniques et l'aisance avec les outils informatiques puisque le poste est très riche en analyse quantitatives et statistiques.

**Activités principales :**

Traitement de données et analyses statistiques

Modélisation financière (méthodes de Monte Carlo...)

Connaissance des produits de marché utilisés pour la couverture du risque de taux (swaps, swaptions, caps, floors...)

**Contacts :**

Imene BEN REJEB-MZAH: [imene.benrejeb-mzah@bnpparibas.com](mailto:imene.benrejeb-mzah@bnpparibas.com) - 01 58 16 75 13

Emmanuelle DAVY: [emmanuelle.a.davy@bnpparibas.com](mailto:emmanuelle.a.davy@bnpparibas.com) - 01 58 16 76 40