

Offre de stage en gestion des risques bancaires Stage conventionné de 6 mois minimum

✂ Entreprise

Nexialog consulting est un cabinet de conseil spécialisé en Banque et Assurance. Organisés autour de 3 pôles d'activité (Risques Bancaires, Assuranciers et Financiers), nous intervenons au sein des équipes métiers afin de les accompagner depuis la stratégie jusqu'à la mise en œuvre de leurs projets.

Associant innovation et expertise, le savoir-faire de notre cabinet nous a permis de consolider notre positionnement sur ce segment et de bénéficier d'une croissance forte et régulière.

✂ Descriptif du stage

Département Risk Management Bancaire :

Le département Risk Management Bancaire intervient au sein de la Direction des risques de Groupes Bancaires de premier plan, dans l'accompagnement à la mise en place de dispositif de mesure et de gestion du risque de crédit, comme :

- la modélisation et la mise en place des indicateurs réglementaire (notation PD, modèles EAD & LGD)
- la mise en place et l'analyse des indicateurs de suivi des risques
- la modélisation de la dépréciation des actifs et du provisionnement (IFRS 9)
- la validation de modèles, le Back Testing et le Stress Testing
- l'accompagnement sur les projets réglementaires (Bale 3, Bale 4)

Nexialog se fixe un objectif d'innovation constante. Chaque année, en collaboration avec le pôle R&D, le département Risque Management Bancaire met en œuvre plusieurs projets afin d'anticiper les besoins de nos clients et d'innover dans la conception de nos solutions.

Objectif du stage :

Accompagné par un collaborateur senior du département RMB et en collaboration avec le pôle R&D, votre sujet de stage sera défini en rapport avec la problématique suivante :

- Modélisation des pertes en cas de défaut.
Par exemple, l'étude inclura la modélisation des récupérations extrapolées pour des facilités de crédit non closes.
- Etude de l'état de l'art.
- Validation et backtest des modèles proposés et benchmark.

Les sujets traités recouvrent une partie d'analyse des besoins, d'état de l'art, de préparation des données, de modélisation, et de restitution des connaissances. Un travail rigoureux de modélisation est attendu.

Vous aurez de plus la capacité de monter en compétences sur des sujets d'actualités et vous serez guidé par un référent métier. Les domaines d'applications sont : Bale3 / Bale 4, IFRS, FRTB, ICAAP, gestion d'actifs...

✂ Profil recherché

Étudiant en dernière année de Grande École d'Ingénieurs ou M2 Statistiques ou Probabilités appliquées, avec une spécialisation en ingénierie financière.

✂ Compétences requises

Maitrise de la modélisation économétrique et probabiliste.
Aisance à l'écrit comme à l'oral. Envie d'apprendre.
Connaissance de SAS, R, Python ou Matlab
Maitrise de l'Anglais (écrit)

✂ Rémunération

Attractive