

Offre de Stage

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 au fil du temps.

✂ Descriptif du stage

Département Recherche et Développement :

Au sein du département R&D, vous serez amenés à travailler en collaboration avec les référents métiers sur une méthode innovante de calcul de marge initiale (IM) dans le contexte EMIR. L'IM est une provision protégeant les contreparties contre les pertes potentielles dues aux variations futures de la position après un défaut. Cette métrique se calcule comme une VaR 99% sur une période de 10 jours. Le calcul exact de la solution étant trop long, les institutions bancaires sont obligées de procéder à des simplifications.

Au cours de cette mission, le stagiaire sera amené à comprendre et développer des algorithmes de métamodelling (Machine Learning) afin d'améliorer la précision et le temps de calcul de la VaR Monte Carlo. Une comparaison avec les méthodes de place est attendue (delta VaR, SIMM).

✂ 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

Maîtrise de la modélisation financière (MC, VaR, Greeks) et des produits de taux (Swap, option).

Connaissance de Matlab, R ou Python.

Aisance à l'écrit comme à l'oral, curiosité et un fort attrait pour les mathématiques financières.

✂ Rémunération

Attractive.