

## 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 modélisation dynamique de la probabilité de défaut dans un contexte Bales III et IFRS9. En effet, il est demandé actuellement aux banques de calculer leurs provisions en cas de défaut des emprunteurs en rapport avec la conjoncture économique (probabilité de défaut Downturn ou Point-In-Time). L'idée de ce stage est de se baser sur des méthodes de Machine Learning ou statistiques (HMM) pour identifier des cycles (paramètres inobservés) à travers le changement de fréquence des migrations de notations Moody's (observations).

#### ✂ 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 et du risque de crédit.

Connaissance de Matlab, R ou Python.

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

Autonomie et capacité d'adaptation.

#### ✂ Rémunération

Attractive.