Offre de stage Risques de marché/Risques de contrepartie

##### Votre Mission

Description de la mission :

Intégré à l’équipe chargée des méthodologies de calcul de risque de marché et de risque de contrepartie, ainsi que des métriques réglementaires, vous participez à l’élaboration et l’amélioration de différents modèles.

Vous devrez vous familiariser avec les métriques utilisées (notamment en risque de contrepartie sur opérations de marché), les textes réglementaires, les modèles de diffusion des différents facteurs de risque, ainsi que les applications internes permettant de calculer toutes ces métriques.

Au cours de ce stage vous participerez à :

* L’automatisation des processus de calibration des modèles de diffusion de risques, des tests de performances et de validation de trajectoires des facteurs diffusés.
* L’élaboration de méthodes adaptées au calcul de sensibilités sur les métriques de risque de contrepartie.
* Le support auprès du Responsable opérationnel.

Apports du poste :

- Vous développez des connaissances sur le calcul de risque de marché et de contrepartie

- Vous découvrez la réglementation bancaire, en refonte perpétuelle

- Vous découvrez un environnement de travail au plus près du front office, mais aussi des régulateurs.

Le stage nécessite des connaissances en finance de marché ainsi que de bonnes compétences en statistiques et en programmation nécessaires à l’implémentation des outils.

Dates et durée de la mission : Avril 2016 – stage de fin d’étude (6 mois).

Lieu de la mission : Tour SG – La Défense.

Gratification : selon grille Société Générale.

##### Profil recherché

Formation : Etudiant(e) de niveau bac+4/5 en école de commerce, école d’ingénieur ou université avec une spécialisation en finance de marché.

Qualités requises : Bonne Connaissance en probabilités/statistiques/programmation

Esprit d’initiative et désir d’approfondissement des connaissances attendus.

Connaissance de base des mathématiques financières et des produits.

Connaissance de la réglementation financière serait un plus.

Bonne maîtrise des outils Excel et programmation en VBA. Programmation en R serait un plus.

##### Contacts

Merci d’adresser votre candidature à :

veronique.chung-roger@socgen.com, [karim.ould-ahmed@socgen.com](mailto:karim.ould-ahmed@socgen.com), [ghislain.essome-boma@socgen.com](mailto:ghislain.essome-boma@socgen.com)