

## **BANQUE DE GRANDE CLIENTELE**

### **GLOBAL MARKETS – ASSISTANT(E) TRADING XVA**

June - 2024

---

#### **OBJET : OFFRE DE STAGE - ASSISTANT(E) TRADING XVA – 3 MOIS MINIMUM**

##### **NATIXIS**

Natixis est la banque de financement, de gestion et de services financiers du Groupe BPCE, deuxième acteur bancaire en France avec 21 % des dépôts bancaires et 36 millions de clients à travers ses deux réseaux, Banque Populaire et Caisse d'Épargne.

Avec près de 22 000 collaborateurs, Natixis intervient dans trois domaines d'activités dans lesquels elle dispose d'expertises métiers fortes : la Banque de Grande Clientèle, l'Épargne et les Services Financiers Spécialisés. Elle accompagne de manière durable, dans le monde entier, sa clientèle propre d'entreprises, d'institutions financières et d'investisseurs institutionnels et la clientèle de particuliers, professionnels et PME des deux réseaux du Groupe BPCE.

##### **CONTEXTE DU STAGE**

La mission se déroulera au sein du desk centralisé de gestion des XVA (CVA/FVA/CoIVA) de « Global Markets ».

Les principales missions du desk sont : le calcul des charges sur les nouvelles opérations, l'évaluation des charges globales sur le portefeuille de dérivés, l'évaluation de leurs sensibilités, la couverture de ces charges en application de la politique adoptée par le management.

##### **DESCRIPTION DE LA MISSION**

Dans ce cadre, vous serez amené(e), sous la supervision de votre tuteur, à conduire les tâches suivantes :

- Automatisation des paramètres exogènes liées à la XVA, notamment les breaks clauses, la liste des contreparties de la banque, l'IM LCH, l'indépendant amount, les pledges, les contreparties garanties, les cross corrélations, les discounts, les courbes de crédit, etc..
- Amélioration de l'outil existant de suivi et d'explication du P&L. Ajout des données live pour l'explain intra-day. Il sera enrichi avec les effets de second ordre (gammas et sensibilités croisées).
- Assister les traders aux tâches quotidiennes du desk : prédiction et explication de P&L, développement et maintenance des outils existants.
- Documentation des développements et présentations aux membres du desk.

##### **COMPETENCES REQUISES**

- 2A École d'Ingénieur ou 3ème cycle universitaire avec spécialisation finance.
- Bonne connaissance des produits dérivés et des principales mesures de risques.
- Excellente maîtrise d'Excel, Python et de SQL.
- La connaissance de C# & VBA constituerait un plus.
- Rigueur, dynamisme et curiosité
- Esprit d'équipe et communication