



La Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) est un établissement public, responsable de la surveillance de l'ensemble de la place financière du Luxembourg, à l'exception du secteur des assurances.

A partir de début 2019, la CSSF propose un stage de fin d'études de Master 2, au sein de son service « **Surveillance des banques** » division « **Risk Management 2** ». Le stage, obligatoirement conventionné par une université, sera à temps plein (40 heures par semaine) et d'une **durée comprise entre 4 et 6 mois**.

**Stage conventionné 2019: Surveillance des banques – Risk Management :**  
**Surveillance des modèles internes de risque de crédit**  
**Réf. « B-Stage 2019 – RISK2 »**

### **Votre stage**

Au sein du service « **Surveillance des banques** », vous intégrez l'équipe en charge de surveiller la gestion du risque de crédit réalisée par les banques, notamment par le biais de l'utilisation de modèles internes de quantification des risques.

Vous travaillerez sur l'élaboration d'outils de surveillance permettant une analyse de la correcte utilisation des modèles internes par les banques. Dans ce contexte vous participerez à l'exercice annuel de « Supervisory Benchmarking » mené au niveau européen et dirigé par l'Autorité Bancaire Européenne (« ABE »). Cet exercice a vocation à comparer la calibration des paramètres de risque (essentiellement probabilités de défaut, pertes en cas de défaut et expositions au moment du défaut) fournis par les modèles internes des banques afin de déceler d'éventuelles anomalies nécessitant des actions correctrices.

Vous serez accompagné(e) par un tuteur professionnel qui vous est dédié, qui vous guide et vous conseille tout au long de votre stage.

### **Nos objectifs**

- Vous faire découvrir les métiers de la surveillance prudentielle au sein du département en charge de surveiller les banques et plus spécifiquement le domaine relatif à la gestion du risque de crédit via l'utilisation de modèles internes pour la quantification de paramètres de risque, et vous initier plus généralement aux métiers de contrôle.
- Faciliter votre insertion dans un milieu professionnel.

### **Votre profil**

- Etudiant(e) fréquentant la dernière année d'études universitaires en vue de l'obtention d'un **Master 2 à orientation mathématique, statistique, économétrique ou financière**.
- Un intérêt marqué pour la gestion des risques financiers et les approches quantitatives.
- Très bonne maîtrise du français, de l'anglais, de l'allemand et du luxembourgeois.
- Bonnes capacités d'analyse, de synthèse et de communication.
- Esprit critique, rigueur et sens de l'organisation.
- Maîtrise des outils Word, Excel (idéalement Visual Basic) et PowerPoint.
- La maîtrise du langage de programmation R est un avantage.
- Capacité à travailler en autonomie et en équipe.

Le dossier de candidature **doit être composé** :

- d'un curriculum vitae détaillé ;
- d'une lettre de motivation ;
- d'une copie de la carte d'identité ;
- d'une copie des diplômes obtenus / relevés de notes.

**Les dossiers incomplets ou non conformes (comme un diplôme qui ne correspond pas à celui requis ou être ressortissant d'un pays qui n'est pas membre de l'UE) ne seront pas considérés.**

Les personnes intéressées sont priées d'adresser leur candidature pour **le 7 octobre 2018 au plus tard** avec la référence du poste à l'adresse e-mail : [recruitment@cssf.lu](mailto:recruitment@cssf.lu)