

M<sup>lle</sup> Mitra GHAVAM-SADOUGHI  
Master II-Ingénierie Financière et Modèle Aléatoire  
Université Pierre et Marie Curie Paris VI

M<sup>me</sup> Muriel ESCRIVA  
Responsable du Département Reporting  
CEIDF 19 rue du Louvre Paris 1<sup>er</sup>

Paris, le 5 Octobre 2009

J'ai intégré la CEIDF pour un stage de fin d'étude d'une durée de six mois, dans le cadre de la formation Ingénierie Financière, dispensée à l'université Paris VI.

La Direction Financière m'a accueilli depuis le 20 Avril, plus précisément au sein du Département Reporting Financier. La CEIDF est une banque de détail (dont la taille du Bilan est de 51.6 Milliards d'euro fin 2008). Elle a développé son activité financière par la réalisation d'opérations de couverture de ses opérations à la clientèle (gestion du risque de taux et de liquidité dans le Bilan), mais également d'opérations sur les marchés financiers pour compte propre. Sur les 15 Milliards d'actifs que comprend le portefeuille financier, 5.7 Milliards sont investis en valeurs mobilières.

Le département Reporting Financier a pour mission de suivre les positions du portefeuille de liquidités et de réaliser des tableaux de bords puis les présenter à la Direction.

Les variations de valeurs de marchés sont analysées par facteur de risque (taux, action, gestion alternative, crédit) et de façon analytique par sous portefeuilles, déterminés dans le cadre de la Politique Financière annuelle.

Des seuils d'alerte, des stop loss et des limites en volume investis sont suivis et présentés à divers comités.

La mission qui m'a été confiée a été le suivi des titres à revenus variables (OPCVM et FCPR). J'ai dû assimiler les process d'informations (tickets émis par le Front-Office), les logiciels dédiés (Front to Back) et les bases de gestion telles que le Département Reporting les a bâti. J'ai également dû me familiariser avec les schémas comptables des valeurs mobilières en IFRS, pour répondre aux besoins des différents reportings.

Une fois cette période d'apprentissage passée, je me suis vu confiée la responsabilité des bases OPCVM et FCPR. J'ai préparé les données pour les Comités de Trésorerie hebdomadaires, sous la supervision de l'équipe.

La responsable du Département m'a sollicitée également sur l'automatisation de certains tableaux de bords, via la recherche et la mise en place de formules sur excel. Elle m'a également confié de simplifier l'organisation des données de la base OPCVM, de façon à optimiser sa manipulation.

En conclusion, l'équipe a su me faire confiance et j'ai pu faire preuve de mes facultés d'adaptation.