

Młodszy Specjalista ds. Modelowania Ryzyka Kredytowego

Bank Millennium S.A.

Twój zakres obowiązków:

- Budowa, aktualizacja, kalibracja i parametryzacja modeli statystycznych służących do kalkulacji oczekiwanych strat kredytowych (zgodnie z IFRS 9),
- Sporządzanie analiz i raportów, mających na celu wyjaśnienie przyczyn zmian poszczególnych parametrów,
- Przeprowadzanie analiz przekrojowych i raportów dotyczących jakości portfela kredytowego Banku,
- Ocena działania modeli,
- Tworzenie dokumentacji modeli,
- Przygotowywanie prezentacji na potrzeby zarządcze.

Nasze wymagania

- Wykształcenie wyższe lub ostatni rok studiów magisterskich, preferowane kierunki: matematyka, statystyka, metody ilościowe w ekonomii, fizyka
- Bardzo dobra znajomość statystyki
- Dobra znajomość Excel, SQL
- Bardzo dobra znajomość języka angielskiego
- Wysokie zdolności analityczne i umiejętność wyciągania wniosków z przeprowadzonych analiz
- Kreatywne i aktywne poszukiwanie rozwiązań
- Umiejętność pracy indywidualnej i współpracy w zespole

Mile widziane

- Doświadczenie w pracy na dużych zbiorach danych
- Doświadczenie w budowaniu modeli statystycznych
- Doświadczenie związane z modelowaniem ryzyka kredytowego
- Znajomość Pakietu R lub Python

To oferujemy

- Możliwość praktycznego wykorzystania wiedzy z zakresu metod probabilistycznych i statystycznych
- Możliwość wykazania się inicjatywą w realizacji zadań
- Przyjazną atmosferę pracy w profesjonalnym i ambitnym zespole
- Pracę w Departamencie Ryzyka w centrali
- Bezpieczne i elastyczne warunki pracy - praca w systemie hybrydowym (home office oraz praca w biurze przy zachowaniu środków ostrożności i uwzględnieniu aktualnej sytuacji epidemicznej)
- Możliwość rozwoju zawodowego i podnoszenia kwalifikacji w ramach struktur Grupy Finansowej Banku Millennium

Benefity

- Umowa o pracę
- Dostęp do platformy kafeteryjnej
- Prywatna opieka medyczna
- Ubezpieczenie na życie
- Dodatkowe świadczenia socjalne
- Kawa / herbata