|  |
| --- |
| **Главный специалист (Data science specialist) Отдела разработки моделей кредитных рисков**Требуемый опыт работы: 1–3 годаПолная занятость, полный день**Наши задачи:**Разработка:моделей оценки кредитных рисков на основе внешних и внутренних данных (корпоративный сегмент);моделей оценки вероятности дефолта по банковским гарантиям. Анализ данных по тендерам;сервисов, работающих с моделями в автоматическом режиме;моделей ценообразования с учетом риска;LGD-моделей;моделей стресс-тестирования;моделей управления финансовыми рисками;моделей экономического капитала;транзакционных моделей.Работа с API внешних источников.Работа с базами данных, создание новых баз данных.Подготовка презентаций и описание рейтинговых моделей.Формирование задач и бизнес-требований по автоматизации процессов и IT-систем.Анализ возможностей и способов улучшения моделей.**С чем предстоит работать в первое время:**Активно реализуется проект по созданию модели для оценки PD по внешним данным. Требуется доработка существующих моделей, добавление новых данных, отбор моделей с наилучшими показателями, работа с XML, json и табличными форматами, а также работа с API и автоматизация расчета рейтинга и работы с базами данных.Помощь в разработке моделей стресс-тестированияУлучшение транзакционной модели**Кто наш кандидат**:Высшее математическое/физическое/техническое/финансово-экономическое образованиеЗнание Python и умение обрабатывать данные. Знание основ sql, pandas, numpy, regex, jsonМатематический склад ума и понимание основ теории вероятностей и математической статистикиУмение работать в команде и ориентация на результатЖелание обучаться и узнавать что-то новоеОрганизованность и самостоятельность в решении задачОпыт полного цикла разработки моделей является плюсом**Что мы можем предложить:**Участие в трансформации процессов в одном из крупнейших банков страныРабота в хорошей команде (выпускник мехмата МГУ и РЭШ, кандидат наук выпускник мехмата МГУ, выпускник ВМК с CFA 3 уровня)Профессиональное развитие в ML и работе с даннымиДМСНовый офис в Москва-СитиКонкурентная заработная плата по итогам собеседованияКлючевые навыки**Python****SQL****Математическое моделирование****Машинное обучение Математическая статистика**Контакт для отклика: *KuzminaNat@rshb.ru*Копия на адрес: GalustovDI@rshb.ru |