|  |
| --- |
| **Главный специалист (Data science specialist) Отдела разработки моделей кредитных рисков**  Требуемый опыт работы: 1–3 года  Полная 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-тестирования  Улучшение транзакционной модели  **Кто наш кандидат**:  Высшее математическое/физическое/техническое/финансово-экономическое образование  Знание Python и умение обрабатывать данные. Знание основ sql, pandas, numpy, regex, json  Математический склад ума и понимание основ теории вероятностей и математической статистики  Умение работать в команде и ориентация на результат  Желание обучаться и узнавать что-то новое  Организованность и самостоятельность в решении задач  Опыт полного цикла разработки моделей является плюсом  **Что мы можем предложить:**  Участие в трансформации процессов в одном из крупнейших банков страны  Работа 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 данными  ДМС  Новый офис в Москва-Сити  Конкурентная заработная плата по итогам собеседования  Ключевые навыки  **Python**  **SQL**  **Математическое моделирование**  **Машинное обучение Математическая статистика**  Контакт для отклика: [*KuzminaNat@rshb.ru*](mailto:KuzminaNat@rshb.ru)  Копия на адрес: GalustovDI@rshb.ru |