

Стажер ВТБ Юниор в отдел бизнес-прогнозирования Департамента розничных кредитных рисков

Описание вакансии:

Мы занимаемся улучшением моделей оценки кредитных и финансовых рисков за счёт тестирования новых статистических и эконометрических подходов, а также перераспределением ресурсов команды от исследовательских задач в сторону решения бизнес-задач. Решаем кейсы с исследованием новых источников данных и задачи путем подготовки данных и тестирования кредитных стратегий, полезные для развития и обучения молодых специалистов, в свою очередь дополнительно повышающие качество результатов. Занимаемся высвобождением ресурсов для инновационных задач. И работаем над созданием кадрового актива и бэкапа для основной команды.

Обязанности:

- решение исследовательских задач, которые в последствии могут быть использованы в бизнес-процессах;
- изучение поведения розничного кредитного портфеля Банка, выделение факторов, влияющих на это поведение;
- разработка эконометрических/статистических моделей оценки поведения портфеля активов;
- проведение стресс-тестирования: оценки влияния на кредитный портфель стрессовых факторов (инфляция, эпидемия и т.д.);
- изучение и применение современных статистических/эконометрических техник с целью улучшения существующих моделей оценки рисков;
- изучение статей/книг с целью нахождения лучших практик применения техник анализа данных для решения задач прогнозирования;
- валидация текущих моделей и разработка инструментов для ее автоматизации;
- подготовка данных посредством выгрузки из хранилища Банка;
- анализ данных на непротиворечивость, наличие/отсутствие ошибок и статистических выбросов;
- тестирование кредитных стратегий банка на соответствие переданным техническим заданиям.

Требования:

- Выпускник бакалавриата 2020/2021 года или студент магистратуры технического / экономического профиля;
- Знание математической статистики;
- Знание Excel, опыт написание запросов в SQL (select, join);
- Английский на уровне чтения зарубежных книг/статей;
- Умение анализировать полученный результат, презентовать руководству. Грамотная речь.

Условия:

- Трудоустройство согласно Законодательству;

- Полный рабочий день;
- Конкурентная заработная плата;
- Профессиональное обучение и развитие;
- ДМС, льготные условия кредитования;
- Спортивная жизнь и корпоративные мероприятия;
- Возможность построить карьеру в ведущем банке России.

Для отклика на вакансию направляйте ваше резюме Варлахиной Валерии : varlahina@vtb.ru