

ERSTE BANK Risk Control:

Quantitativer Spezialist für Structured Finance, Kreditderivate

Die Einheit und ihre Aufgaben:

Group Market Risk Control ist im Konzern eine zentrale risikoüberwachende Einheit mit folgenden Aufgabengebieten:

1. Konzernweite Berechnung aller Marktrisiken auf Basis Value at Risk sowie Betrieb und Weiterentwicklung des Internen Modells (zentrale interne Risikosteuerung und lokaler Modellbetrieb in den Töchtern).
2. Risk Control Structured Finance: Quantitative Analyse (Deal- Bewertung, Risikoanalyse, Risikoaggregation).

Die Aufgaben der Stelle:

- Structured Finance & Kreditderivate: Mitarbeit bei der Modellierung und Integration neuer Produkte.

Im Bereich Structured Finance suchen wir eine quantitativ orientierte Persönlichkeit, deren Aufgabenschwerpunkt die Mitarbeit bei der Umsetzung der Modellierung von Structured Credit Produkten (CDOs und Credit Funds verschiedenster Asset Klassen wie Loans, Bonds, ABS) sein wird.

Die Anforderungen:

- Abgeschlossenes Hochschulstudium (vorzugsweise Statistik, Mathematik, Informatik oder Wirtschaftswissenschaften)
- Schwerpunktqualifikation - Quantitative Finance: Modellierungstechniken, numerische Verfahren, Stochastic Calculus, theoretische und praktische (wünschenswert) Produktkenntnisse
- EDV- Kenntnisse, idealerweise in: C/C++, VBA, SQL, R
- Teamfähigkeit, Flexibilität und Belastbarkeit
- Sicheres Auftreten und gute Präsentationsfähigkeit
- Verhandlungsfähige Englischkenntnisse (Konzernsprache)

Falls nicht alle fachlichen Anforderungen vollständig erfüllt werden können, besteht die Möglichkeit Wissenslücken mit Unterstützung erfahrener Mitarbeiter zu schliessen.

Die Anstellung:

Da die Stelle eine Karenzvertretung ist, ist sie befristet. Eine Anstellung kann für 6 Monate in Vollzeit von Mitte April bis Oktober erfolgen und danach in Form eines geringeren Teilzeitverhältnis für ca. 6 Monate fortgesetzt werden.

Eine Aufteilung in zwei Teilzeitstellen ist generell ebenso möglich, falls gleichzeitig zwei sich ergänzende Kandidaten gefunden werden können, die Anstellung einer Person wird jedoch bevorzugt. Wir wenden uns speziell an solche Interessenten, die vor allem über theoretische Erfahrung verfügen (z.B. Dissertanten, Universitätsassistenten) und gerne für einen befristeten Zeitraum praktische Erfahrung sammeln wollen.

Wenn Sie an der Mitarbeit in einem topaktuellen Bereich des Risikomanagements in einem hochmotivierten, jungen Team interessiert sind, dann schicken Sie bitte Ihre Bewerbung mit Lebenslauf an:

Mag. Günther Smisch
Head of Group Market Risk Control
Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
OE 382 Group Market Risk Control
A-1010 Vienna, Neutorgasse 6-8/1/111, Tel: +43 (0)5 0100 - 19052
mailto:guenther.smisch@erstebank.at