

Ratingmethoden

Quantitativer Spezialist / Statistiker für Entwicklung und Validierung

Die Einheit und ihre Aufgaben:

Die Einheit Ratingsysteme & Methoden ist in der Erste Bank-Gruppe für die Entwicklung, Implementierung und Betreuung von Ratingmodellen zur Erreichung des Basel II IRB-Ansatzes verantwortlich.

Für die Mitarbeit in diesen Bereichen suchen wir eine Persönlichkeit mit fundierten mathematisch-statistischen Kenntnissen, deren Aufgabenschwerpunkt die Entwicklung und Validierung von Ratingmodellen sein wird.

Die Aufgaben der Stelle:

- Weiterentwicklung und Validierung der vorhandenen Methoden, basierend auf statistischen Verfahren (z.B. Logistische Regression)
- Definition von Datenerfordernissen, Datenaufbereitung und Datenqualitätskontrollen
- (Re-) Spezifikation von Modellen und Kalibrierung auf Ausfallwahrscheinlichkeiten
- Analyse und Nachjustierung der Modelle durch Überprüfung und Validierung der Ergebnisse aus der praktischen Anwendung
- Dokumentation der Ratingmodelle sowie Präsentationen für Anwender, Entscheidungsgremien und Aufsichtsorgane
- Zentrale Ansprechperson für die Töchter in der Erste Bank-Gruppe zum Thema Ratingverfahrenentwicklung und -validierung

Die Anforderungen:

- Abgeschlossenes Hochschulstudium (Technische Mathematik, Statistik, Versicherungsmathematik oder ein natur/wirtschaftswissenschaftliches Studium mit quantitativer Ausrichtung)
- Praktische Erfahrung in der statistischen Datenanalyse von Vorteil
- EDV-Kenntnisse: MS Office (Word, Excel), SQL, Statistik-Paket (SAS Kenntnisse wünschenswert)
- Basel II Kenntnisse von Vorteil
- Eigeninitiative, Durchsetzungsfähigkeit und Belastbarkeit
- Sicheres Auftreten und gute Präsentationsfähigkeit
- Gute Englischkenntnisse in Wort und Schrift
- Bereitschaft zu Dienstreisen im In- und Ausland

Die Anstellung:

Die Stelle ist nach erfolgreicher Probezeit unbefristet und soll möglichst bald besetzt werden. Eine bereits vorhandene EU- Arbeitserlaubnis ist Voraussetzung für die Stelle.

Wenn Sie an der Mitarbeit in einem aktuellen, aufstrebenden Bereich des Risikomanagements interessiert sind, dann schicken Sie bitte Ihre Bewerbung mit Lebenslauf an:

Mag. Franz Ellmeier
OE 649 Ratingsysteme & Methoden
Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
A-1010 Vienna, Brandstätte 7-9
Tel: +43 (0)5 0100 – 12794
<mailto:franz.ellmeier@erstebank.at>