

Стажер

Вакансия для тех, у кого есть навыки программирования в Python, R, VBA, SQL и начальные уровни экзаменов FRM\CFA!

Обязанности:

- Сбор и анализ данных для разработки и валидации моделей оценки кредитного риска по различным сегментам портфелей банков-клиентов
- Анализ научной литературы, а также регуляторных требований центральных банков стран региона Центральной Азии и Кавказа, ЕЦБ, МСФО в части моделей оценки финансовых рисков
- Проверка расчетов и методологий расчетов ожидаемых кредитных убытков (ECL) в соответствии с МСФО 9
- Проверка расчетов и методологий расчетов справедливой стоимости финансовых инструментов в соответствии с МСФО 13: корпоративные облигации, гарантии, займы со встроенным опционом и финансовые деривативы (валютные форварды, процентные/валютные свопы, американские/экзотические опционы)
- Проверка расчетов и проверка методологий расчетов оценки договоров страхования и обязательств по вознаграждениям работников в соответствии с требованиями МСФО 17 и МСФО 19
- Подготовка коммерческих предложений, презентаций и отчетов с результатами проектов по улучшению моделей оценки кредитного и рыночного рисков, методик и процессов по их применению

Требования:

- Высшее математическое, техническое или экономическое/финансовое образование (допускается последний курс бакалавриата)
- Знание теории вероятности и основ статистики
- Базовые знания математического и финансового моделирования
- Базовые знания бухгалтерского учета и финансов
- Умение работать с большими объемами данных
- Владение английским языком на уровне не ниже Intermediate.

Наши преимущества:

- Международная компания с офисами по всему миру
- Быстрый карьерный рост
- Широкий спектр возможностей для обучения и развития
- Конкурентоспособное вознаграждение и социальный пакет

Резюме отправлять на почту: anel.bekbossynova@kz.ey.com