

# Jera

【国内最大手・世界最大級の発電会社】最適化部門におけるリスク管理業務：データ分析・オプションモデル構築（担当～主任）

『世界のエネルギー問題に、最先端のソリューションを提供する』

## Job Information

### Hiring Company

JERA Co.,Inc.

### Job ID

1474396

### Industry

Petrochemical, Energy

### Job Type

Permanent Full-time

### Location

Tokyo - 23 Wards

### Salary

Negotiable, based on experience

### Refreshed

June 28th, 2024 10:00

## General Requirements

### Minimum Experience Level

Over 3 years

### Career Level

Mid Career

### Minimum English Level

Business Level

### Minimum Japanese Level

Native

### Minimum Education Level

Bachelor's Degree

### Visa Status

Permission to work in Japan required

## Job Description

### 職種 / 募集ポジション

【最適化】最適化経営部 リスク管理ユニット オプション分析・モデル構築担当（担当～主任）

当部署は、最適化部門の中で、リスク管理に関わる全体計画・分析・管理・運用を担っています。最適化部門の事業は、会社全体の連結売上高の大部分を占めており、また、連結純利益に多大な貢献をしています。当部署はその最適化部門における事業すべてのリスク管理を担うという重要な役割を持っています。燃料調達・輸送から、発電、電力/ガス販売に至る、世界最大級のエネルギーバリューチェーンの経済的な運用のため、燃料調達、及び電力・燃料販売、それぞれのポートフォリオのリスク分析、リスク管理インフラの構築、運用、リスク削減策の立案まで手掛け、変化が激しいエネルギー業界において、安定的、経済的な事業運営の一翼を担っていただきます。世界レベルでの巨大なエネルギーの流れを作りつつ、且つ国内の3割以上の発電量を支える事業者としてより先進的な脱炭素化も推進しており、時代に即したチャレンジを続ける当社で新たなキャリアを構築し、ビジネスの最前線、常に最先端の取り組みを続ける当社のリスク管理担当者としての活躍を期待しています。

### 仕事内容

#### ■コモディティマーケットのデータ分析

- ・燃料、電力、天候などのデータ取得およびボラティリティや相関、分布の調査分析
- ・上記データのフィージビリティチェックや適合性検証 等

#### ■オプションモデルの構築・運用

- ・各種コモディティモデルのキャリブレーション精度や安定性の比較検証
- ・上記の自動化やシステム構築 等

※オプションモデル開発の経験はなくてもよいが、学ぶ意欲は必須。

#### ■リスク計測業務

- ・日次でのVaRやPLの計測、レポート等

#### ポジションの魅力

当ポジションにおける業務を通じてエネルギー業界のマーケットやモデルへの知見を深めて頂くことで、最近注目のエネルギーオンツとしてご活躍頂けるようになります。

燃料調達／トレーディングから発電に至るまでのバリューチェーン全体を管理する当部門だからこそ扱える商品やビジネスも多く、そのプライシングモデルを考えるという大変知的好奇心のくすぐられるポジションです。

あなたもその一員に加わってみませんか。

#### 部門の役割

- ・最適化部門におけるリスク管理全体統括
- ・電力・燃料ポートフォリオのリスク分析・計測、リスクヘッジ削減策の立案
- ・クレジットリスク管理
- ・リスク管理インフラの構築、運用

## Required Skills

#### 求める経験・スキル

<必須>

- ・理数系もしくは経済系の大学院卒（それに準ずる業務経験があれば学卒でも可）
- ・ボラティリティ、相関、分布、統計的検定などのデータ分析業務の経験（2～5年程度）
- ・SQLやExcelによるデータ取得や分析の経験
- ・ファイナンス全般やオプションモデルに関する基礎知識
- ・確率、統計、解析、微分方程式などを理解する数理的思考力
- ・英語論文やマニュアルの読解が可能な英語力

<歓迎>

- ・金融工学や数理ファイナンス関連の大学院卒
- ・金融業界やエネルギー業界におけるプライシングモデルの開発経験
- ・先物、オプション、スワップなどのデリバティブマーケットに関する知見
- ・VBA、Pythonなどのプログラミング経験
- ・証券アナリスト資格（CMA、CFA）
- ・市場リスク管理やXVAに関する知見
- ・海外子会社や業者との英語会議が可能な英語力
- ・外部プライシングライブラリ（Numerix、FinCAD、BBG DLib等）利用経験

#### 雇用形態

正社員

#### 給与

応相談

#### 勤務地

東京都中央区日本橋2丁目5-1（日本橋高島屋三井ビルディング25階）

※社規程等により在宅またはサテライトオフィス等での勤務が可能。

※ただし、業務の必要により東京、名古屋、海外拠点（欧米・アジア・豪州等）などに配転・転勤・出向等を行うことがある。

#### 勤務時間

1. フレックスタイム制

勤務時間は7時00分から22時00分の間で自主的に決定し、コアタイムは設けないものとする。

ただし、1日最低4時間以上勤務しなければならない。

2. 休憩時間

1時間

3. 所定時間外労働 有

#### 休日

土曜日、日曜日、国民の祝日に関する法律で定める休日、年末年始（12/29～1/3）

#### 福利厚生

カフェテリアプラン、住宅関連手当、財産形成貯蓄、財形給付金、慶弔贈与、永年勤続表彰 等（各種支給条件あり）

#### 加入保険

雇用保険、労災保険、介護保険、厚生年金保険

## Company Description