



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

株式会社JERAでの募集です。 リスク管理のご経験のある方は歓迎です。

Job Information

Recruiter

JAC Recruitment Co., Ltd.

Hiring Company

株式会社JERA

Job ID

1505986

Industry

Specialized Import, Export

Job Type

Permanent Full-time

Location

Tokyo - 23 Wards

Salary

6 million yen ~ 8 million yen

Work Hours

09:00 ~ 17:40

Holidays

【有給休暇】 初年度 15日 1か月目から 【休日】 完全週休二日制 夏季休暇 年末年始 普通休暇 入社時に初年度最大15日 (入社...

Refreshed

November 21st, 2024 16:57

General Requirements

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

【求人No NJB2165770】

<仕事内容>

■コモディティマーケットのデータ分析

- ・燃料や電力、天候などのデータ取得およびボラティリティや相関の計算
- ・上記データの分布（正規分布、対数正規分布等）検証

■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

■リスク計測業務

・日次でのVaRやPLの計測、レポート等

Required Skills

【必須 (MUST)】

- ・理数系もしくは金融系の学部または大学院卒
- もしくは、以下のいずれかの経験をお持ちの方
- ・リスク管理もしくはデリバティブに関連した業務経験
- ・確率論、微分方程式、数理ファイナンスなどの応用数学に取り組んだ経験

【歓迎 (WANT)】

- ・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・オプションなどのデリバティブマーケットに関する知見
- ・SQLやExcel、Rなどの統計ツールによるデータ取得や分析の経験
- ・VBA、Pythonなどのプログラミング経験
- ・英語論文やマニュアルの読解が可能な英語力（英語会議がこなせるレベルだと尚良）
- ・外部プライシングライブラリ（Numerix、Bloomberg (DLIB) 等）利用経験

Company Description

株式会社JERAは、東京電力株式会社（当時）および中部電力株式会社の燃料上流・調達から発電までのサプライチェーン全体に係る包括的アライアンスを実施する会社として、2015年4月30日に設立されました。2016年7月には、両社の燃料事業、海外発電事業等の承継を完了し、世界有数のエネルギー企業として、本格的に始動いたしました。エネルギー事業を取り巻く環境は、資源価格の変動や、規制緩和の影響など、多くの不確実性にさらされています。同社は、東京電力と中部電力から承継した事業規模と、サプライチェーン全体に関与できる事業領域の幅広さを強みとし、この不確実性に対処してまいります。東京電力、中部電力がこれまで培ってきたマインドをベースに、今後、事業の規模と領域をさらに拡大し、JERAのミッションである、国際競争力ある電力・エネルギーの供給の実現、および世界の豊かなくらしと産業・経済の活力向上に、積極的に貢献してまいります。◆事業内容・火力発電事業・再生可能エネルギー事業・ガス・LNG事業・上記各事業に関するエンジニアリング、コンサルティング など