



## 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**

1516991

**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**

January 24th, 2025 10:18

### 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、レポートニング等

---

### 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