



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。

募集職種

人材紹介会社

株式会社ジェイ エイ シー リクルートメント

採用企業名

株式会社JERA

求人ID

1505986

業種

専門商社

雇用形態

正社員

勤務地

東京都 23区

給与

600万円～800万円

勤務時間

09:00～17:40

休日・休暇

【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...)

更新日

2024年11月21日 16:57

応募必要条件

キャリアレベル

中途経験者レベル

英語レベル

ビジネス会話レベル

日本語レベル

ネイティブ

最終学歴

大学卒：学士号

現在のビザ

日本での就労許可が必要です

募集要項

【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

スキル・資格

【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

会社説明

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