



【融資企画部】投融資ポートフォリオのサステナビリティリスクマネジメント（主に気候変動リスクに係る定量分析およびモデル開発）

株式会社三菱UFJ銀行での募集です。 クオンツ・アクチュアリー・金融工学・数理...

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

株式会社三菱UFJ銀行

求人ID

1507998

業種

銀行・信託銀行・信用金庫

雇用形態

正社員

勤務地

東京都 23区

給与

600万円～1300万円

勤務時間

08:40～17:10

休日・休暇

【有給休暇】初年度 14日 1か月目から 【休日】完全週休二日制 土日 祝日 GW 夏季休暇 年末年始 毎年3月31日現在に...

更新日

2024年12月19日 08:01

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 NJB2265355】

【ミッション・役割】

- MUFGビジネスに係る気候変動リスク（移行リスク・物理的リスク）の定量的評価・分析手法の構築及び高度化
- 定量化した気候変動リスクに対する社内管理体制及び国内外当局要請を踏まえた適切な情報開示体制の構築

【業務内容】

サステナビリティリスクに関する以下のクオンツ分析業務を既存メンバーと協力して取り組んでいただくことを想定

- データベース構築、シナリオ分析やストレステストを含む気候変動リスク（移行リスク・物理的リスクおよびその統合）に関する定量化モデルの構築

2. 潜在的な気候変動リスクに関する各種金融商品取引・ポートフォリオの多角的な脆弱性分析、モデルオーナーとしてモデルのパフォーマンス評価・検証・既存モデルの改修
3. 定量化した気候変動リスクをリスク・リターン運営の中で適切に管理するための社内体制の構築（信用格付やプライシングへの反映等）、既存の信用リスク評価プロセスへの統合
4. 気候変動リスクに関連する非財務情報（排出量実績・Financed Emission・レジリエンス等）に対する分析・将来予測の実施、マネジメント宛報告
5. 上記を正確且つ安定的に実施する社内の態勢・プロセス及び開示に必要な内部統制の整備

スキル・資格

【必須】

■スキル

- ・ExcelやPythonによるモデル開発やデータ解析のためのプログラミング技術
 - ・業務遂行に必要な基礎的な数理・経済・金融に関する知識
 - ・業務遂行に必要な英語力（TOEIC730点以上目安）
- （上記項目について条件を満たさない場合、習得意欲高く取り組める場合は可）

■人物面

- ・中長期的に当該分野でのプロフェッショナルを目指す方
- ・コミュニケーション能力が高く、多様性を尊重しながらチームで協力しながら業務に取り組める方

【尚可】

- ・内部統制や開示・規制対応等に向けた対応（モデルドキュメント作成、ストレステスト、感応度分析、モデルオーナーとしてのモデル検証）が可能な方
 - ・マクロ経済モデルや経済シナリオ作成モデルを用いた分析経験（気候変動影響を勘案したGDP、株価、金利などをシミュレーションし、投融資先や金融商品のプライシングを通じた個社レベル・ポートフォリオレベルのリスク量計測）
 - ・本邦および海外当局対応に関し、MUFGヘッドクォーターとして海外拠点のリスク計測に関するサポート対応が可能な方
- ※いずれも必須ではありません

【歓迎】

- ・金融機関、コンサル、シンクタンク、官省庁、研究機関などでリスク管理業務経験
- ・バイサイドでの投資戦略モデル開発やリスク管理モデル開発の経験
- ・気候変動予測やその経済・金融システムへの影響分析経験（研究機関などでそのような研究経験がある方）
- ・物理学や数学、ファイナンス理論（金融工学など）、統計・情報、数理経済学等の分野で基礎的な教育を受けた方

会社説明

銀行業務全般（商業銀行業務、投資銀行業務）