

Analista Cuantitativo de Validación Interna - Modelos de Riesgo de Crédito

Requisitos:

- Experiencia profesional inferior a 3 años/sin experiencia previa.
- Licenciado en Económicas (perfil cuantitativo), Matemáticas, Estadística, Física, etc.
- Programa superior o similar en finanzas cuantitativas.
- Experiencia en modelización.
- Conocimiento de SAS.
- Imprescindible alto nivel de inglés. Se valorará portugués y alemán.
- Valorable conocimientos de Basilea II y modelos internos de riesgo de crédito.
- Valorable experiencia en desarrollo de scorings, ratings, modelos de estimación de parámetros regulatorios y modelos de stress-test.
- Valorable experiencia previa en validación/auditoría de modelos IRB.
- Carácter abierto, facilidad de trabajo en equipo.
- Disponibilidad para viajar

Se ofrece incorporación en el Departamento de Validación Interna con responsabilidad global dentro del Grupo Santander para realizar tareas de validación de modelos y de las carteras AIRB de la entidad así como otros tipos de modelos de gestión de riesgos (Stress Test, capital económico, provisiones, etc.), incluyendo tanto aspectos cuantitativos como aspectos cualitativos de la gestión de las carteras y cálculo del capital regulatorio.