

## Referent Risikoparameter (m/w)

Spezialkreditinstitut, Köln

### Profil:

- Eigenständige Wahrnehmung der Überwachung hinsichtlich Angemessenheit und Trennschärfe der eingesetzten Methoden nach regulatorischen und ökonomischen Vorgaben.
- Überprüfung und Umsetzung der Anforderungen an eine Adressrisikoüberwachungseinheit nach § 152 SolvV ff. zur Erreichung der IRB-Zulassung
- Entwicklung von Methoden und Instrumenten zur Messung, Quantifizierung und Klassifizierung von Risiken, die sich aus der Geschäftstätigkeit des Hauses ergeben
- Vorbereitung und eigenständige Wahrnehmung von Aufgaben beim jährlichen Validierungsprozess (Datenaufbereitung, Validierungsanalyse, Validierungsdokumentation) nach regulatorischen Vorgaben
- Dokumentationspflege der eingesetzten Methoden für die Ermittlung der Ausfallwahrscheinlichkeiten und der Verlustquoten zur Erreichung regulatorischer Konformität
- Entwicklung der Kalibrierung sowie Weiter- und Neuentwicklungen der bestehenden Methoden sowie Methoden der neuen Portfolien nach regulatorischen und ökonomischen Vorgaben
- Entwicklung von Maßnahmen für die laufende Methodenentwicklung
- Beobachtung methodischer Entwicklungen aus regulatorischer, ökonomischer und statistisch / mathematischer Sicht
- Eigenständige Wahrnehmung von Aufgaben beim jährlichen Revisions- und JA-Prozess nach MaRisk zur Methodenprüfung
- Laufende Überwachung der eingesetzten Bonitätsbewertungssysteme und zu schätzenden Risikoparameter
- Integration der Methoden und Instrumente in die EDV-technischen Abläufe, Prozesse und Systeme

### Anforderungen:

- Abgeschlossenes Studium der Mathematik/Physik, alternativ Betriebswirtschaftslehre / Volkswirtschaftslehre mit Affinität für mathematische Themenstellungen
- Sehr gute Erfahrungswerte in der Anwendung und Entwicklung von Risikomessverfahren
- Sehr gute Kenntnisse in der Bonitäts- und Branchenanalyse
- Mehrjährige Berufserfahrung im Risikomanagement eines Finanzdienstleistungsunternehmens / Beratungshauses / eCommerce-Hauses
- Projekterfahrung, gerne auch auf Projektleitungsniveau
- Ausgeprägtes analytisches Denkvermögen
- Schnelles Auffassungsvermögen
- Sehr gute Englischkenntnisse in Wort und Schrift

Frankfurt  
Taubenstraße 1  
60310 Frankfurt  
Telefon: 069 - 77 033 692

Düsseldorf  
Königsallee 2b  
40212 Düsseldorf  
Telefon: 0211 - 83 68 949

München  
Bergwerkstraße 2a  
83714 Miesbach  
Telefon: 08025 - 92 79 998