

<b>Pracovní pozice:</b>	Senior analytik tržních rizik, Risk management
-------------------------	--

<b>Počet přímých podřízených:</b>	0	<b>Nadřízený (pozice):</b>	Manažer tržních rizik, Risk Management
-----------------------------------	---	----------------------------	--

**Popis práce:****Název pozice:** Senior analytik tržních rizik, Risk management**Popis, charakteristika pozice:**

- Podílí se na řízení tržních rizik, rizika likvidity, řízení aktiv a pasiv s cílem zajistit spolehlivé a efektivní řízení v souladu s regulací a interními pravidly MMB

**Hlavní přínosy:**

- Podílí se na vývoji a udržování metodiky řízení tržních rizik a rizika likvidity, řízení aktiv a pasiv
- Kontroluje operace prováděné oddělením Treasury, sleduje čerpání limitů, komunikuje s oddělením Treasury
- Podílí se na správě a udržování systémů a infrastruktury k řízení tržních rizik a rizika likvidity, řízení aktiv a pasiv
- Ve spolupráci s ostatními útvary implementuje požadavky regulátora pro oblast řízení tržních rizik a likvidity
- Reportuje tržní rizika a riziko likvidity podle interních požadavků banky

**Hlavní odpovědnosti:**

- Spolupráce na vývoji a validaci modelů používaných pro řízení aktiv a pasiv, řízení tržních rizik a rizika likvidity, zajištění správné implementace modelů při měření rizik (zejména úrokový a likviditní gap a návazné metriky používané pro měření úrokového rizika)
- Zajištění správného nastavení a fungování systému Bancware (zejména ALM části), návrhy změn v nastavení systému, testování a implementace změn
- Provádění stresového testování pro tržní rizika (zejména úrokové riziko) a riziko likvidity
- Monitorování dodržování limitů pro řízení tržních rizik a rizika likvidity, samostatné řešení případů, kdy jsou limity překročeny
- Testování a spolupráce při implementaci změn v Treasury systému
- Přípravování reportů a ad-hoc analýz v oblasti řízení tržních rizik a likvidity, řízení aktiv a pasiv
- Podílení se na přípravě podkladů pro řídicí výbory banky a ČNB výkaznictví
- Podílení se na vývoji nových Treasury produktů
- Posuzování rizik plynoucích z Treasury operací, návrh a implementace změn v procesech za účelem zlepšení kontrolních mechanismů a zajištění správného a efektivního reportingu
- Návrhy a implementace změn v datovém skladu za účelem zlepšení kvality dat používaných pro řízení tržních rizik a rizika likvidity, řízení aktiv a pasiv
- Samostatná komunikace s Auditem (interním i externím) v oblasti řízení tržního rizika a likvidity

**Požadavky:**

- Vysokoškolské vzdělání
- Alespoň dvouletá zkušenost v oblasti Treasury/řízení tržních rizik a rizika likvidity/řízení aktiv a pasiv
- Analytické schopnosti
- Znalost regulace bankovního trhu
- Znalost SQL
- Pokročilá znalost MS Office (Excel) a znalost některého ze statických softwarů (např. SAS, R)
- Komunikační dovednosti
- Komunikační znalost angličtiny

**Výhodou:**

- Znalost kvantitativních metod ve financích
- Znalost IFRS
- Pokročilá znalost databázových systémů