



## AP1 söker chef för Risk- & avkastningsanalys

*Första AP-fonden är en statlig myndighet med uppdrag att förvalta bufferten i det svenska inkomstpensionssystemet. Fonden förvaltar tillgångar till ett värde av cirka 432 miljarder kronor vid halvårsskiftet 2021 i en portfölj bestående av aktier, räntebärande värdepapper, fastigheter, infrastruktur, riskkapitalfonder och hedgefonder. Ungefär 60 procent av portföljen är investerad utomlands. Fonden investerar långsiktigt och hållbart med mål att långsiktigt bidra till en hög och förutsägbar inkomstpension för nuvarande och framtida pensionärer genom väl avvägda finansiella risker. Första AP-fonden är en arbetsplats där ansvarstagande, samarbetsförmåga och en lösningsorienterad inställning värderas högt.*

Läs mer på [www.ap1.se](http://www.ap1.se)

AP1 söker en chef till Risk- och avkastningsanalys som idag består av totalt tre personer. Risk- och avkastningsanalys är en del av verksamheten (första linjen) inom enheten Operations. Tjänsten kommer att rapportera till chefen för Operations.

### Arbetsbeskrivning

Risk- och avkastningsanalys ansvarar för beräkning och analys av fondens portföljexponering, risk och avkastning. I detta ingår ett rapporteringsansvar till affärsverksamheten, styrelsen samt till enheten för Riskkontroll. Rapporteringen ska spegla utfallet av investeringsprocessens beslutsnivåer i både absoluta och relativa termer.

Gruppen utvärderar löpande fondens olika förvaltningsmandat i form av automatiserad analys tillgänglig för hela fonden. På specifika uppdrag genomförs djupare utvärdering av valda förvaltningsmandat. Analysen utförs självständigt och oberoende och innehåller egna slutsatser.

Enheten är också ansvarig för att AP1s portfölj- och indexstruktur är korrekt nedbruten i enlighet med portföljstrukturen i fondens verksamhetssystem (portfölj-, risk- och avkastningssystem). För riskanalys arbetar fonden i dagsläget främst med risksystemet Barra, för avkastningsanalys används Pearl. Som chef för gruppen kommer du också att vara systemägare för dessa två system. Fondens huvudsakliga verksamhetssystem är Simcorp Dimension.

I arbetsuppgifterna ingår också att implementera automatiserad bevakning av identifierade risker/limiter som löpande behöver följas upp av verksamheten.

Som chef för enheten förväntas du också medverka aktivt i ledning, planering och strategiarbete inom Operations samt verka för ett bra samarbete såväl inom enheten som inom fonden som helhet. En viktig del av chefens roll är också att kontinuerligt verka för att utveckla och fördjupa fondens risk- och avkastningsanalys.



## Din bakgrund

Vi söker dig med akademisk examen, företrädesvis inom finans, ingenjörsvetenskap eller matematik. Vi ser också att du har flerårig erfarenhet av arbete inom kapitalförvaltning med finansiell risk samt avkastningsanalys. Du har också erfarenhet av att arbeta med konfiguration av finansiella verksamhetssystem (gärna specifikt Barra, Pearl & SCD).

Du har mycket goda kunskaper om finansiella instrument och värderingsprinciper, en stark analytisk problemlösningsförmåga och en förmåga att arbeta självständigt. Du både vill och kan ta ansvar för ditt och enhetens arbete.

För att lyckas i rollen som chef har du ett coachande, engagerande och prestigelöst ledarskap. Genom detta förhållningssätt har du förmågan att få en grupp att fungera väl tillsammans. Du trivs med att arbeta strukturerat.

Du har en mycket god förmåga att presentera komplexa resonemang och argument till fondens styrelse och andra seniora beslutsfattare. Vi värdesätter också samverkan och förmågan att skapa konstruktiva och goda relationer.

Du är en nyfiken person som gillar utmaningar. Du har en mycket god förmåga att uttrycka dig i tal och skrift på svenska och engelska.

## Ansökan

Har du frågor om tjänsten kan du mejla fondens chef för Operations, Mats Enebrink, [mats.enebrink@ap1.se](mailto:mats.enebrink@ap1.se)

Din ansökan till tjänsten och Första AP-fonden skickar du till [rekrytering@ap1.se](mailto:rekrytering@ap1.se). Skicka in din ansökan snarast då urval och intervjuer sker löpande, sista ansökningsdag är den 17:e januari, 2022.

Välkommen med din ansökan!