

Analista Cuantitativo Riesgo Mercado y Liquidez para el equipo de TI y Finanzas Cuantitativas de la Gerencia de Riesgo Integral Mercado y Liquidez dependiente de la división de Riesgo Corporativo del Banco de Crédito e Inversiones (BCI).

El objetivo del cargo consiste en el desarrollo de modelos y herramientas con un foco cuantitativo para mejorar la toma de decisiones y gestión de riesgos de mercado, balance y liquidez.

Este equipo se encarga del análisis y desarrollo de modelos cuantitativos para la correcta medición y gestión de riesgos estructurales de balance y liquidez y riesgos de mercado y contraparte, como los son la medición de riesgos de mercado del libro de Banca, gestión de coberturas contables, análisis de estabilidad de diferentes productos, establecer límites de posiciones, ajustes de valor prudentes del libro de Trading, escenarios de tensión y proyecciones entre otros.

Las principales responsabilidades son:

- Desarrollar modelos/herramientas para mejorar la medición y gestión de riesgos de mercado, contraparte, balance y liquidez.
- Llevar las herramientas desarrolladas a una etapa y ambiente productivo.
- Leer, investigar, analizar y replicar investigaciones financieras o afines para incorporar mejores prácticas y conocimientos en el desarrollo del área.
- Mantención y documentación de código y desarrollos actuales.

Requisitos:

- Ing. Civil Industrial, Matemática o afines con 0 - 1 año de experiencia.
- Dominio avanzado de lenguajes de programación: Python, R, u otros.
- Competencias analíticas en el ámbito de macroeconomía y finanzas.

Deseables:

- Título de Magíster en Economía, Finanzas o área analítica afín.
- Conocimiento de técnicas de modelamiento estocásticos, modelos económico/financiero, Deep learning con enfoque de carácter temporal.
- Conocimiento del mercado financiero local.
- Dominio de gestores de bases de datos (SQL Server, Oracle).
- Dominio de inglés.
- Dominio de herramientas de visualización (Python, Power BI).

Si estás interesado y consideras que tu perfil encaja con lo que buscamos, te invitamos a enviar tu currículum vitae actualizado al siguiente correo electrónico: gabriel.vergara@bci.cl