

# Matias Febles

## Curriculum Vitae



La Crujia 3662, Codigo Postal 1651, Buenos Aires, Argentina

05-12-1986



+54 (011) 6502-5325



feblesmatias@gmail.com



<https://www.linkedin.com/in/matias-febles-10552616/>

## EXPERIENCIA LABORAL

ACTUAL, DESDE MAYO 2019

CRISIL - Consultor para Mizuho - BA, Argentina

### **Analista Cuantitativo Senior**

Programa de transición de tasa IBOR en plataforma MUREX. Validación de modelos derivados de IR y FX. Modelos: European Swaptions con SABR volatility, Bermudan Swaptions, Cross Currency Swaps, Average Rate Options y Average Rate Forwards usando EUR ESTR y USD SOFR como tasas de descuento.

OCTUBRE 2018 – ABRIL 2019

CRISIL - Consultor para Morgan Stanley - New York, USA

### **Analista Cuantitativo Senior**

Validación de modelos de Market Risk. Implementación independiente de tecnicas de predicción como random forest y decision trees codeadas en R y Python.

AGOSTO 2017 – OCTUBRE 2018

CRISIL - Consultor para Citibank - BA, Argentina

### **Analista Cuantitativo Senior**

Análisis de riesgo de instrumentos exóticos derivados de Equity e Híbridos (IR/FX/COMM). Análisis y evaluación de la metodología implementada. Diseño de pruebas de calibración, benchmarking, performance computacional, casos límites, estabilidad y convergencia. Testeo de escenarios CCAR. Responsable de la documentación técnica y confección de reporte ejecutivo.

MAYO 2014 – AGOSTO 2017

YPF - Petróleo - BA, Argentina

### **Ingeniero de Proyectos de Refinería**

Lider del equipo de automatización y control del revamping de planta FCC (Fluid Catalytic Cracking). Trabajo de investigación: "Análisis de tecnología de transmisión de datos Wireless HART en combinación con radio Ethernet para ambientes industriales".

MARZO 2010 – ABRIL 2014

Allegro MicroSystems - Microelectrónica - BA, Argentina

### **Ingeniero IC Layout**

Diseño de sensores de efecto Hall integrados.

## EDUCACIÓN

2021 – 2022

### **Master en Finanzas**

Universidad Torcuato Di Tella

2016

### **Programa de Finanzas Cuantitativas**

Universidad del CEMA

2005 – 2013

### **Ingeniero Electrónico**

Universidad Tecnológica Nacional

## COMPUTACIÓN

PLATAFORMAS	Murex
LENGUAJES DE PROGRAMACIÓN	Python, R, VBA, C, SQL, $\text{\LaTeX}$

## IDIOMAS

ESPAÑOL	Nativo
INGLES	Avanzado

## OTRAS ACTIVIDADES

### *Algorithmic Trading*

Desarrollo de un sistema de trading algoritmico en python para tradear Criptomonedas usando la API de Binance.

## HOBBYS

### *Deportes*

Jugar Futbol y Paddle.