

Horacio Nicolás Tanzi

Validador de Modelos Financiero | Mg. en Economía



nicotanzi



nico-tanzi



nico.tanzi@gmail.com



11 3619 0894

EXPERIENCIA LABORAL

VALIDADOR DE MODELOS - ANALISTA CUANTITATIVO | KEVIN D. ODEN & ASSOCIATES

Abr 2022 – Presente

- Realizo auditorías de modelos financieros y de toma de decisiones para bancos de EEUU. He trabajado en, e.g., modelos de probabilidad de default, de fraude, de series de tiempo proyectando spreads de tasas de interés, entre muchos otros.
- Mi trabajo implicó un profundo entendimiento de cada modelo, su documentación, la teoría subyacente, su aplicación y el contexto empresarial en el que se utiliza.
- Desarrollé ejercicios de back-testing y benchmarking para probar la eficacia de los modelos.
- Redacté informes de validación detallados en inglés, destacando los problemas detectados y proporcionando evidencia respaldatoria.

PROFESOR UNIVERSITARIO | UBA, UCA, UCEMA, UDeSA, USAL, UTDT, UB

Marzo 2020 – Presente

- Clases Prácticas de Macroeconomía Recursiva; Maestría UdeSA
- Clases prácticas de Teoría Microeconómica 1; UBA y UCEMA
- Clases teóricas de Teoría Microeconómica 1 y 2; USAL
- Clases prácticas de Introducción a la Microeconomía; UCA y UdeSA
- Clases teóricas y prácticas de Econometría; UB
- Clases prácticas de Introducción a la Macroeconomía; UCA y UTDT

GERENTE DE ADMINISTRACIÓN | WIKIMEDIA ARGENTINA

Marzo 2019 – Marzo 2020

DESARROLLO DE MODELOS DE RIESGO | BEEX

Enero 2018 – Febrero 2019

- Estuve a cargo del desarrollo de un modelo ALM (Asset Liability Management) para el Banco Hipotecario.
- El modelo que desarrollé calcula los cashflows de todos los activos y pasivos del banco en su cartera de inversión, y luego los descuenta conforme a diferentes curvas de tasas de interés.
- Diseñé la implementación del modelo para permitir al usuario personalizar diferentes escenarios y supuestos, facilitando la estimación del riesgo de la cartera de inversiones del banco.

PROFESOR DE ECONOMÍA Y ESTADÍSTICA | IMATH (INSTITUTO PRIVADO DE ENSEÑANZA)

Junio 2018 – Febrero 2020

- Impartía clases particulares de Microeconomía, Macroeconomía y Estadística.

ASISTENTE ESTADÍSTICO | FIEL (CONSULTORA MACROECONÓMICA)

Octubre 2016 – Diciembre 2017

- Trabajé en la elaboración del FIEL Macroeconomic Forecast, un informe cuatrimestral centrado en proyecciones macroeconómicas.
- Las principales tareas eran data-entry, data-visualization, análisis de series de tiempo y escritura de informes.

ESTUDIOS

U TEXAS AT AUSTIN

MASTER'S IN DATA SCIENCE

2024-presente

Cursando (50% completado)

U. DE SAN ANDRÉS

MAESTRÍA EN ECONOMÍA

2019

Promedio 8

Asistente de Investigación de D. Pierri

U. DE BUENOS AIRES

LICENCIATURA EN ECONOMÍA

2013 - 2018

Promedio 8

Ayudante en: Microeconomía 1, 2 y Estadística 2

U. CATÓLICA ARGENTINA

DERECHO

2011 - 2013

Incompleta

Apoyo escolar en la Villa 1.11.14

CONOCIMIENTOS

PROGRAMACIÓN

Con fluidez:

Julia • R • $\text{L}^{\text{A}}\text{T}_{\text{E}}\text{X}$ • Python

Con experiencia:

SQL • SAS • VBA • MATLAB
Stata • CSS • HTML

LIBRERÍAS

ggplot2 • dplyr • pandas
numpy • pytorch • scikit-learn

HERRAMIENTAS/ PLATAFORMAS

Git • VSCode • JupyterLab

IDIOMAS

Inglés fluído, oral y escrito

Portugués con estudios iniciales