

Il Gruppo BCC Iccrea è il maggiore gruppo bancario cooperativo, l'unico gruppo bancario nazionale a capitale interamente italiano e il quarto gruppo bancario in Italia per attivi. Oggi il Gruppo è costituito da 117 Banche di Credito Cooperativo, presenti in oltre 1.700 comuni italiani con quasi 2.500 sportelli, e da altre società bancarie, finanziarie e strumentali controllate da BCC Banca Iccrea.

La Capogruppo BCC Banca Iccrea offre l'opportunità di svolgere uno stage presso l'Unità Modelli e Analisi Quantitativa dell'Area Chief Financial Officer.

La persona in stage avrà possibilità di formarsi relativamente alla progettazione, allo sviluppo, verifica e mantenimento dei modelli matematico-finanziari per il calcolo del fair value ("mark to model") e delle sensitivities degli strumenti finanziari non quotati (titoli obbligazionari, derivati).

In particolare, la persona approfondirà le seguenti attività:

- progettazione, sviluppo, verifica e manutenzione dei modelli di pricing per il calcolo del fair value, ai fini gestionali e contabili, degli strumenti finanziari (titoli obbligazionari, derivati) e dei prodotti di investimento assicurativi detenuti nel portafoglio di proprietà della Capogruppo, delle Società del Perimetro Diretto e delle Banche Affiliate;
- verifica, attivazione e configurazione dei modelli di pricing presenti nativamente nei sistemi di position keeping;
- definizione, di concerto con le linee operative, dei dati di input da acquisire dai broker/provider (Bloomberg, Reuters ecc.) da utilizzare nei modelli di pricing/hedging degli strumenti finanziari;
- verifica a chiamata dei dati di mercato e dei modelli valutativi interessati, nel caso in cui si osservi uno scostamento significativo tra la valutazione di strumenti finanziari OTC effettuata dalla Capogruppo e quella fornita dalle controparti di mercato;
- definizione dei criteri per la scomposizione degli strumenti finanziari;
- realizzazione di analisi quantitative a supporto della gestione operativa, da parte della Finanza di Gruppo, dei rischi di mercato, di controparte, di tasso e di liquidità;
- supporto alla Funzione IT fornendo, ove necessario, le specifiche funzionali per l'implementazione dei modelli nei sistemi di position keeping, affiancando inoltre il Front Office nelle attività di collaudo del pricing e delle sensitivities.

Requisiti:

- Laurea magistrale in Matematica, Informatica, Ingegneria, Fisica;
- buona conoscenza pratica di almeno uno dei seguenti linguaggi di programmazione: C/C++, C#, Python, Visual Basic.

- rappresenta valore aggiunto la conoscenza teorico/pratica degli strumenti finanziari e delle principali metodologie della moderna matematica finanziaria come ad es. Derivati su tassi d'interesse, inflazione, credito, sottostanti azionari e prestiti obbligazionari: caratteristiche, valutazione e calcolo delle sensitivities; Short rate e market models per tassi di interesse e inflazione , modelli relativi al rischio di credito (Processi di Poisson, Copula function ecc.) e ai sottostanti azionari; metodi numerici, quali ad es. metodologia Monte Carlo, alberi trinomiali e differenze finite;
- conoscenza intermedia della lingua Inglese ;
- capacità di analisi, problem solving, lavoro in gruppo, comunicazione.

In caso di interesse, leggi attentamente l'informativa sulla privacy riportata nell'area Privacy del sito web di BCC Banca Iccrea e invia la tua candidatura allegando il cv. Ti ricordiamo che, ai sensi dell'art. 111-bis del Codice Privacy, non è necessaria l'autorizzazione al trattamento dei dati personali presenti nel tuo cv.

La ricerca rispetta il d.lgs. 198/2006 ed è aperta a candidature di qualsiasi orientamento o espressione di genere, orientamento sessuale, età, etnia e credo religioso. Il Gruppo BCC Iccrea riconosce che l'attenzione delle diversità, l'inclusione e la tutela dell'equilibrio fra vita privata e vita professionale siano principi fondamentali di creazione di valore per il Gruppo stesso.