

Programa de Especialización

Finanzas Cuantitativas y
Valoración de Derivados










Introducción y Objetivos

El objetivo del curso es poder dotar al alumno con unos recursos que le capaciten para comprender y desarrollar la valoración de derivados, su gestión en términos de riesgo, así como el desarrollo de cualquier razonamiento o modelo cuantitativo necesario para dicho proceso, así como su implementación y automatización.

A quién va dirigido

Es recomendable pero no imprescindible perfiles con base sólida en matemáticas.

-  Front Office: Estructuración, Trading
-  Riesgos: Mercado, Contraparte, XVA
-  Auditoría
-  Consultoría
-  Wealth Management
-  Utilities relacionadas con las commodities
-  Interesados en la materia

Programa

CURSOS DE HOMOGENEIZACIÓN:

1. Matemáticas
2. Introducción a R y Python

DESARROLLO DEL CURSO:

1. Presentación e Introducción
2. Fundamentos Estadísticos y Matemáticos
3. Futuros y Forwards
4. Opciones Financieras
5. Modelos de Valoración de Opciones
6. Sensibilidad de las Opciones
7. Estrategias de Derivados:
 - a. Construcción
 - b. Evaluación de Resultados
 - c. Performance de Sensibilidades
8. Opciones Exóticas
9. Volatilidad Histórica
10. Volatilidad como Activo
11. Renta Fija
12. Duración y Convexidad
13. Derivados de tipo de Interés
 - a. Construcción
 - b. Cálculo
 - c. Largo Plazo
14. Swaps
15. Caps, Floors y Collars
16. Swaption
17. Derivados de Crédito
18. Derivados sobre Divisas
19. Derivados sobre Commodities
20. Control del riesgo: Value At Risk
21. FRTB: Cálculo y Definiciones
22. XVAs
23. Productos Estructurados y Coberturas
24. Contabilidad de Derivados

Claustro

Profesionales del sector que aplican día a día los conocimientos que serán impartidos ostentando Másteres en **Finanzas Cuantitativas**, certificaciones como **CFA, FRM, CQF, CAIA** y **estudios de doctorado** que avalan sus conocimientos en las materias versadas.

DIRECTOR DEL PROGRAMA

Jose Lope Alba

Head of Quantitative Analysis, W2M, S.A. - CQF & FRM, PhD Candidate

Alberto Librero Guerra

Financial Markets & Structuring Director, ABANCA

Antonio Arguedas Fernández

Director, Intermoney Consulting

Antonino Giaquinta

Risk Specialist, BBVA

Carlos Izquierdo Alarcón

Financial Engineer, SS&C - MSc Quantitative Finance
- FRM

David Maldonado Sánchez

ALCO Portfolio Manager, Banco Sabadell -FRM

Fanny Concepcion Alonzo Cáceres

Senior Quantitative Analyst for Interest Rate,
Credit and Inflation, BBVA

Ignacio Chavarrías Jiménez

VP - IA - Institutional Client Group, Citi

Javier González Castejón

Senior Geotechnical Engineer, Ocean Winds- PhD
Candidate

Juan Babiloni Cebadera

Foreign Exchange Trader
Managing Director, PNC Bank
CAIA y FRM

Óscar Gil Flores

Executive Director, Technology Design & Strategy,
GRM Analytics, BBVA - CFA & FRM

Roberto Knop Muszynski

Director Asociado Data Analytics, Analistas
Financieros Internacionales - Phd, MFIA, MRICS &
CESGA (ESG)

Sergio Avilés Pastor

Gestor Fondos de Inversión, Gestifonsa SGIIC.
Banco Caminos

Soledad Seivane Navia

Senior Executive Director, Admission, Fair Value &
Capital, GRM CIB, BBVA

Cristina Osuna Gomez

Executive Director, Corporate & Investment Banking,
Global Markets, BBVA

Daniel Cremades Rubio

Managing Director
Global Head, XVA Trading
BBVA Global Markets

Duración y Modalidad



3 DÍAS A LA SEMANA
De 19 a 22 horas



MODALIDAD
Presencial / Online

El Programa de 145 horas de duración se imparte 3 días por semana de 19.00 a 22.00h.

Admisión y Titulación

Los aspirantes a cursar el Programa deberán presentar un breve currículum vitae, un formulario de inscripción, DNI o pasaporte escaneado.

Las solicitudes deben ser enviadas a:



p.posgrado@ieb.es

Una vez el alumno supere todos los requisitos y pruebas del Programa, obtendrá un título de Especialista expedido por IEB.

Coste

Precio: 3.850€

Este importe incluye todos los costes académicos, como material, claustro, documentación necesaria para el programa y acceso a las instalaciones y servicios de IEB.



C/Alfonso XI, número 6



91 524 06 15



www.ieb.es



p.posgrado@ieb.es