

Programa de Especialización Finanzas Cuantitativas y Valoración de Derivados



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**.



Modalidad Presencial/Streaming



Título de Especialista



3 días/semana de 19-22h



145h



4.200€

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.

Jose Lope Alba

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

Alberto Librero Guerra

Financial Markets & Structuring Director, ABANCA

Ignacio Chavarrías Jiménez

VP - IA - Institutional Client Group, Citi

Antonio Arguedas Fernández

Director, Intermoney Consulting

Javier González Castejón

Senior Geotechnical Engineer, Ocean Winds- PhD Candidate

Antonino Giaquinta

Risk Specialist, BBVA

Juan Babiloni Cebadera

Foreign Exchange Trader, Managing Director, PNC Bank
CAIA y FRM

Carlos Izquierdo Alarcón

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

Óscar Gil Flores

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

Cristina Osuna Gomez

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

Roberto Knop Muszynski

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

Daniel Cremades Rubio

Managing Director, Global Head, XVA Trading
BBVA Global Markets

Sergio Avilés Pastor

Gestor Fondos de Inversión, Gestifonsa SGIIC. Banco Caminos

David Maldonado Sánchez

ALCO Portfolio Manager, Banco Sabadell - FRM

Soledad Seivane Navia

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

Fanny Concepcion Alonzo Cáceres

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

Programa

CURSOS DE HOMOGENEIZACIÓN

1. Matemáticas
2. Introducción a R y Python

DESARROLLO DEL CURSO

1. Álgebra y Cálculo determinista
2. Fundamentos estadísticos y matemáticos
3. Introducción Cálculo Estocástico
4. Programación: R Python
5. Estrategias de Derivados: Futuros y Forwards/Estrategia de derivados: Opciones
6. Opciones Financieras
7. Volatilidad
8. Sensibilidad de las opciones y Estrategias de derivados: Evaluación de Resultados
9. Optimización de Portfolios: Teoría de Carteras
10. Opciones exóticas
11. Derivados de tipo de Interés
12. Swaps
13. Modelos de Tipos
14. Caps Floors Collars
15. Swaptions
16. Riesgo Crédito: Modelización de parámetros
17. Derivados de Crédito
18. Commodities
19. FX
20. Inflación: divergencias en las políticas de los principales bancos centrales y las implicaciones en el mercado de divisas (G10)
21. Riesgo de Mercado: Métricas de Riesgo
22. Fundamental Review of Trading Book
23. XVA
24. Productos Estructurados y Coberturas
25. Contabilidad de Derivados

A quién va dirigido

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