

# 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

### David Maldonado Sánchez

ALCO Portfolio Manager, Banco Sabadell -  
FRM

### Marcos de Castro

Profesor Asociado y Quant Senior Advisory  
- Family Office

### Antonio Arguedas Fernández

Director, Intermoney Consulting

### Hugo Antonio Navarro Flores

Director del Staff de Control de Riesgos,  
Cajamar

### Oscar Gil Flores

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

### Antonino Giaquinta

Risk Specialist, BBVA

### Ignacio Chavarrías Jiménez

VP - IA - Institutional Client Group, Citi

### Roberto Knop Muszynski

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

### Arturo Labanda

Risk Director, Methodology and Model  
Construction en Banco Santander

### Ignacio Ramos

Principal Manager Data Scientist, BBVA

### Sergio Avilés Pastor

Gestor Fondos de Inversión, Gestifonsa  
SGIIC. Banco Caminos

### Carlos Izquierdo Alarcón

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

### Javier González Castejón

Senior Geotechnical Engineer, Ocean Winds  
- PhD Candidate

### Daniel Ayquipa Gonzales

IA Manager, Deloitte

### Jorge Peris

Quantitative Risk Manager, Intermoney

### Victoria Hidalgo Díaz

Data Scientist - Advance Analytics  
Global Market Risk COE - Corporate and  
Investment Banking, BBVA

### Daniel Cremades Rubio

Managing Director, Global Head, XVA  
Trading, BBVA Global Markets

### Juan Babiloni Cebadera

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

## 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