

# 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**



**3.850€**

## 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