

17,18 y 19 de Febrero 2020

Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



Finanzas cuantitativas Aplicadas a valoración de instrumentos de activos



Afi Escuela



Finanzas cuantitativas aplicadas a valoración de instrumentos de activos



Introducción

El desarrollo de nuevos productos financieros y la acelerada complejidad del mercado de las finanzas, requiere unos instrumentos específicos para analizarlo y modelarlo. Esta situación ha generado la necesidad de incorporar a personas con un perfil más cuantitativo en el mundo financiero..

El contenido del curso ofrece una formación práctica avanzada en el ámbito financiero (bonos, tipos de interés, divisa, etc.), como en la metodología y las herramientas necesarias para su análisis, con el objetivo de formar a especialistas capaces de diseñar, valorar y modelizar productos, evaluar riesgos y tomar decisiones financieras con una visión estratégica de mercado.

Dirigido a

Profesionales de banca, seguros, bolsa, etc., que se enfrentan en su día a día a la modelización analítica de problemas de mercados financieros.

Objetivos

Este curso tiene como objetivo dotar al alumno de amplios conocimientos sobre las herramientas y técnicas cuantitativas necesarias para la modelización del comportamiento de las variables financieras, la valoración y cobertura de las diferentes familias de instrumentos derivados, y la medición y control de los riesgos financieros.



Finanzas cuantitativas aplicadas a valoración de instrumentos de activos



PROGRAMA

1. Valor temporal del dinero y estructura de tipos de interés. Tipos implícitos
2. Interpolación de tipos y de factores de descuento
3. Instrumentos habituales en una cartera de activo y su valoración
 - I. Instrumentos de renta fija. Spreads de crédito
 - II. Swaps (IRS) y cross currency swaps (CCS)
 - III. Futuros y forwards
 - IV. Opciones:
 - a) Variables que determinan su prima
 - b) Valor intrínseco y temporal
 - c) Europeas y americanas
 - d) Opciones sobre equity: Marco de Black-Scholes, descomposición de Cholesky, simulación Monte Carlo
4. Ejemplos: valoración de un bono de tipo fijo, bono de tipo variable, IRS, CCS, call/put plain vanilla y sensibilidad a inputs, worst-off sobre una cesta de equity, opción asiática

Finanzas cuantitativas aplicadas a valoración de instrumentos de activos



DIRECCIÓN ACADÉMICA Y PROFESORADO

Giovanni Negrete

Director Adjunto, XVA desk en Santander

Carlos Pazos

Rates Derivatives Trader en HSBC Global Banking and Markets

DURACIÓN, FECHAS Y LUGAR

- Este programa consta de 12 horas de duración.
 - Se imparten los días 17,18 y 19 de Febrero 2020.
- Horario de 17:30 a 21:30 horas.

- SEDE

Asociación de Bancos de México, 16 de septiembre 27 Col. Centro 06500 Ciudad de México.

METODOLOGÍA

El Programa se imparte por profesionales de Afi Escuela de Finanzas y la Asociación de Bancos de México.

La metodología de trabajo es PRESENCIAL y eminentemente práctica. Las exposiciones teóricas se complementarán con la realización de ejercicios, ejemplos y análisis de casos prácticos, con el doble objetivo de permitir a los asistentes la puesta en marcha de los conceptos aprendidos a lo largo del programa y facilitar su participación y el compartir de sus experiencias con los ponentes y el resto de los asistentes.



Finanzas cuantitativas aplicadas a valoración de instrumentos de activos



El importe de la inscripción es de

\$ 16,500.00



INSCRIPCIÓN

- Se formalizará la inscripción enviando un correo a educacioncontinua@abm.org.mx con el comprobante de pago antes del inicio del curso.
- Si es miembro de la Asociación de Bancos de México consulte la promoción disponible para asociados en: educacioncontinua@abm.org.mx.
- Las cancelaciones deberán comunicarse por escrito a la dirección de correo electrónico educacioncontinua@abm.org.mx y darán derecho a la devolución del 100% del importe de la inscripción siempre que se comuniquen con al menos una semana de antes a la fecha de inicio del curso.

Los ponentes podrían variar por causa de fuerza mayor.



Especialistas en Economía, Finanzas y Tecnología



www.afiescueladefinanzas.es
AV Paseo de la Reforma 296 piso 41,
Col. Juárez, 06600 CDMX
+52 (55) 52 07 35 65
afiescueladefinanzas@afi.es



www.abm.org.mx
Asociación de Bancos de México, 16
de Septiembre 27, Piso 3, Col. Centro,
06000 CDMX
educacioncontinua@abm.org.mx