

PROGRAMA COMPLETO

Curso Avanzado de Trading

Seminario 1

Trading con Spreads

Fecha: 16 de enero, 2021 / Horario: de 10:00 a 14:15 / Duración: 4 horas

PONENTE:

SERGIO MUR.

“Máster en Finanzas y Riesgos Financieros” por el Instituto de Estudios Financieros (IEF) y por BME (Bolsas y Mercados Españoles). “Licenciado en Economía” por la Universidad de Barcelona. Ha desarrollado su carrera profesional desde el 2001 como Gestor de Fondos de Inversión y como Trader en diversas instituciones financieras, realizando tareas de prop-trading en Fx, Derivados y Equity. Desarrollador de sistemas automáticos de trading, gestión y desarrollo de aplicaciones y/o técnicas de Money Management. Ha sido también responsable del área de análisis técnico de una conocida entidad financiera.

En el año 2008 fue el ganador de la XTB Trading Cup, mediante inversión en Fx, en España al que se presentaron más de 15.000 traders. Ha sido ponente y colaborador en Formación de Mercados Financieros y de varios cursos de post-grado en varias escuelas de finanzas. En la actualidad desarrolla su labor profesional en Ursus-3 Capital Agencia de Valores y es Partner de la consultora financiera “Hoplos”.

PROGRAMA:

Módulo 1. Introducción al Trading no direccional o delta neutral

- Conceptos básicos
- Correlación y cointegración entre activos
- Creación de ratios y ponderación de spreads

Módulo 2. Instrumentos financieros en la operativa de spreads

- Spreads con acciones y ETF's
- Spreads con derivados: futuros y CFD's
- Combinaciones entre instrumentos (Acciones Vs CFD's, Futuros Vs Acciones...)
- Spreads entre índices, corporates y sectoriales

Módulo 3. Activos correlacionados

- Análisis cuantitativo para selección de estrategias
- Análisis gráfico de ratios entre spreads
- Toma de decisiones de trading

Módulo 4. Activos descorrelacionados

- Análisis cuantitativo para selección de estrategias
- Técnicas de análisis técnico de momentum para selección de activos.
- Debilidad versus fortaleza entre activos
- Toma de decisiones de trading

Módulo 5. Puesta en práctica, mercado real, plataformas de negociación

- Búsqueda, selección de activos y estrategias.
- Construcción de ratios
- Seguimiento gráfico de spreads
- Puntos de entrada y de salida
- Estrategias acumulativas
- Creación y ejecución de órdenes

Seminario 2

Trading Estacional en Renta Variable

Fecha: domingo 17 de enero, 2021

Horario: de 10:00 a 14:15

Duración: 4 horas.

PONENTE:

ROBERTO MARCOS

Trader institucional. Experto en el diseño de algoritmos de inversión mediante reglas mecánicas robustas, machine learning, inteligencia artificial y data mining. Fundador de varias startups tecnológicas, más de 14 años de experiencia en la inversión cuantitativa tanto como investigador como inversor. Su operativa no se fundamenta en el uso de indicadores ni en el análisis gráfico, sino en la búsqueda de anomalías recurrentes que le proporcionen una ventaja estadística.

PROGRAMA:

Módulo 1. Introducción a la Estacionalidad

- ¿Qué es la estacionalidad?
- ¿Por qué se produce la estacionalidad?
- Tipos de estacionalidades

Módulo 2. Diseños de herramientas de búsqueda estacional básica

- Estrategias de búsqueda rápida
- Estrategias de búsqueda profunda
- Estrategias de búsqueda en proximidad de “festivos”
- Carteras estacionales de invierno para Renta Variable americana
- Carteras estacionales de invierno para Renta Variable europea

Módulo 3. Diseño de búsqueda Estacional Avanzado con Stock Picking

- Técnica de Búsqueda Inversa usando ETFs.
- Técnica de Búsqueda por Tramos.
- Validación de Filtros Stock Picking.

Módulo 4. Filtros de Marketing Timing con datos fundamentales

- Con datos de empleo.
- Con datos intermercados.

Módulo 5. Técnicas Avanzadas

- Selección de zonas robustas.
- Filtros de liquidez.
- Validación cruzada.
- Diseño con deslistadas
- Estrategias de incorporación
- Creación y ejecución de órdenes

Módulo 6. Construcción del Calendario de Carteras Estacionales

Seminario 3

Trading con “Price Action”

Fecha: sábado 23 y domingo 24 de enero, 2021

Horario: de 10:00 a 14:15

Duración: 8 horas.

PONENTE:

SERGIO MUR.

“Máster en Finanzas y Riesgos Financieros” por el Instituto de Estudios Financieros (IEF) y por BME (Bolsas y Mercados Españoles). “Licenciado en Economía” por la Universidad de Barcelona. Ha desarrollado su carrera profesional desde el 2001 como Gestor de Fondos de Inversión y como Trader en diversas instituciones financieras, realizando tareas de prop-trading en Fx, Derivados y Equity. Desarrollador de sistemas automáticos de trading, gestión y desarrollo de aplicaciones y/o técnicas de Money Management. Ha sido también responsable del área de análisis técnico de una conocida entidad financiera.

En el año 2008 fue el ganador de la XTB Trading Cup, mediante inversión en Fx, en España al que se presentaron más de 15.000 traders. Ha sido ponente y colaborador en Formación de Mercados Financieros y de varios cursos de post-grado en varias escuelas de finanzas. En la actualidad desarrolla su labor profesional en Ursus-3 Capital Agencia de Valores y es Partner de la consultora financiera “Hoplos”.

PROGRAMA

Módulo 1. Indicadores y osciladores técnicos

- Estudio de los principales indicadores y osciladores técnicos
- Eficiencia, defectos y virtudes
- ¿Por qué el precio es el mejor indicador?

Módulo 2. Indicadores de última generación. Heiken Ashi

- Heiken Ashi construcción e interpretación del indicador.
- Funcionamiento y análisis de barras o velas
- Barras o velas de indefinición y de continuidad
- Uso del Heiken Ashi como stop loss y stop de beneficios

Módulo 3. Trading sin indicadores. Price Action

- El precio como mejor indicador: Trading sin indicadores.
- Barras o velas de señal
- Falsas Rupturas y Reversals
- Dobles impulsos

Módulo 4. “Price Action” aplicado sobre velas Heiken Ashi

- Análisis de ondas, impulsos y tendencias de mercado
- Detección de patrones de giro
- Patrones de continuación de tendencia
- Señales de entrada y salida de mercado
- Gestión de posiciones con técnicas de gestión monetaria

Seminario 4

Gestión Monetaria (Money Management)

Fecha: sábado 30 de enero, 2021

Horario: de 10:00 a 14:15

Duración: 4 horas.

PONENTE:

JAVIER ROMERO

Certified Financial Technician (CFTe), Máster en Mercados Financieros e Inversiones Alternativas (MFIA)". "Licenciado en Administración y Dirección de Empresas" por la Universidad Europea. "Máster en Mercados Financieros" por la Universidad San Pablo CEU, y "Especialista en Gestión de Carteras y Productos Derivados" por el Instituto BME

Trader independiente. Socio Fundador de "Optimo Trade Formación S.L.". Experto en diseño de "técnicas de trading" y "técnicas de gestión monetaria y risk management". Codirector del Curso "Análisis & Trading Profesional" del Instituto BME. Ha impartido cursos en entidades financieras como Credit Suisse, Caja Madrid Bolsa, Banesto Bolsa y BNP Paribas. Ha sido Supervisor de Mercado en Meff (BME) y Analista Macroeconómico en Merrill Lynch (London).

PROGRAMA

Módulo 1. Money Management. Conceptos clave:

- ¿Qué es el money management?
- La importancia del money management.
- El Experimento de Ralph Vince.
- La importancia del comienzo. El apalancamiento asimétrico.
- La esperanza matemática / Pay off
- Probabilidad de ruina -risk of ruin-.
- Estrategias martingala versus anti-martingala.

Módulo 2. Estrategias de money management:

- Fixed Fractional o Fixed Risk.
- Regla del 2% (Alexander Elder).
- Fórmula de Kelly.
- Fixed Ratio.
- Profit Risk Method.

Módulo 3. Elaboración de un "diario de trading/operaciones":

- ¿Por qué se necesita un "diario de *trading*"?
- Partes que forman un "diario de *trading*":
 - o 1º Parte: plan de trading.
 - o 2º Parte: diario de operaciones.
 - o 3º Parte: conclusiones.