

Curriculum vitae - síntesis

Datos personales

- **Nombre completo: Mauricio Labadie Martínez**

Áreas de especialización

- Finanzas Cuantitativas
- Python
- Probabilidad
- Estadística
- Análisis
- Ecuaciones Diferenciales Ordinarias
- Ecuaciones Diferenciales Parciales
- Topología Diferencial
- Teoría del Control

Formación académica

- Doctorado en Matemáticas
 - Institución: Sorbonne Université (Université Pierre et Marie Curie)
 - Lugar: París, Francia
 - Tesis: Ecuaciones de reacción-difusión en Biología
 - Asesor: Dr. Henri Berestycki
 - Título obtenido en diciembre 2011
- Maestría en Finanzas
 - Institución: Université Paris Dauphine-PSL
 - Lugar: París, Francia
 - Tesis: Trading algorítmico óptimo y microestructura de mercado
 - Asesor: Dr, Charles-Albert Lehalle
 - Título obtenido en octubre 2010
- Maestría en Matemáticas Aplicadas
 - Institución: Sorbonne Université (Université Pierre et Marie Curie)
 - Lugar: París, Francia

- Tesis: El efecto del crecimiento en la formación de patrones en Biología
- Asesor: Dr. Henri Berestycki
- Título obtenido en septiembre 2006

Experiencia académica (*últimos cinco años*)

- Profesor del Seminario de Finanzas I: Finanzas Cuantitativas con Python
 - Facultad de Ciencias, UNAM.
 - Semestres: 2024-1, 2021-2, 2021-1
- Profesor del Seminario de Finanzas II: Criptoconomía
 - Facultad de Ciencias, UNAM.
 - Semestres: 2023-1
- Sinodal de tesis doctoral en Matemáticas
 - Institución: University College London (UCL)
 - Lugar: Londres, Reino Unido
 - Título: Trading automático usando métodos estocásticos
 - Fecha: 2018

Experiencia profesional

- Trader de Riesgo Central (Central Risk Book o CRB)
 - De noviembre 2017 a diciembre 2020
 - Institución: Credit Suisse
 - Lugar: Londres, Reino Unido
 - Labores:
 - Toma de decisiones en trading y gestión de riesgo del CRB
 - Líder de productos cuantitativos del CRB, incluyendo el algoritmo de “hedging” de portafolios usado para cubrir cada posición entrante
 - Creación e implementación de algoritmos de trading en correduría de bolsa, tanto de portafolios como de single-asset
 - Creación de un protocolo de data mining en Python para analizar y calificar el rendimiento y riesgo de las transacciones
 - Creación de un protocolo de backtesting en Python para programar, implementar y evaluar estrategias de arbitraje estadístico
 - Creación de estrategias de trading propietario o de riesgo, tanto sistemáticas como fundamentales

- Trader y Quant Algorítmico
 - De agosto 2014 a octubre 2017
 - Institución: Credit Suisse
 - Lugar: Londres, Reino Unido
 - Labores:
 - Líder de productos cuantitativos de la correduría de bolsa automatizada de Credit Suisse (llamada AES)
 - Entre los algoritmos gestionados destacan: ejecución de portafolios de acciones, trading de bloques, “implementation shortfall” o variación respecto al precio inicial, posicionamiento de órdenes límite basado en volatilidad
 - Creador de un simulador de mercado para backtest y calibración de algoritmos tipo VWAP (volume-weighted average price)
- Quant (investigador cuantitativo)
 - De octubre 2011 a septiembre 2013
 - Institución: Exqim (hedge fund)
 - Lugar: París, Francia
 - Labores:
 - Creación, backtesting e implementación de estrategias de arbitraje estadístico en futuros de acciones
 - Investigación en microestructura de mercado, trading algorítmico, ejecución óptima, control estocástico
- Conferencias
 - Organizador y único ponente de varios “workshops” en Finanzas Cuantitativas
 - Institución: Facultad de Ciencias, UNAM
 - Lugar: CDMX, México
 - Tópicos:
 - Machine Learning, trading algorítmico, arbitraje estadístico, trading de alta frecuencia, microestructura de mercados, gestión de portafolios, ETFs, zoología financiera
 - Años: 2019, 2018, 2016, 2014, 2012

Reconocimientos

- Tesis doctoral: “mention très honorable”
- Tesis de Maestría en Finanzas: ganadora del Premio Natixis 2011 a la mejor tesis de maestría en Finanzas Cuantitativas