

MIÉRCOLES, 15 DE JULIO

SESIÓN 5. Presidente: Miguel Ángel Martínez Sedano (Universidad del País Vasco)	
9:30-10:15	Ryan Monkerud. "Estudio de la Influencia de los Prepagos Exógenos sobre el Cupón Incremental de una Hipoteca". Director: Eliseo Navarro (Universidad de Castilla-La Mancha). Comentarista: Cristóbal González Baixauli (Universidad de Valencia)
10:15-11:00	Álvaro Montealegre. "Estimación de tipos cupón cero y estructura temporal de volatilidades. Impacto en la valoración de derivados sobre tipos de interés". Director: Eliseo Navarro (Universidad de Castilla-La Mancha). Comentarista: Gloria Soto (Universidad de Murcia)
11:00-11:45	Julen Álvarez. "Valoración de opciones autocancelables mediante modelos de volatilidad GARCH". Director: Unai Asenjo (Universidad del País Vasco). Comentarista: Javier Fernández Navas (Universidad Pablo Olavide)
11:45-12:30	Descanso

SESIÓN 6. Presidente: Vicente Meneu (Universidad de Valencia)	
12:30-13:15	Idoya Ferrero. "Aproximación al gobierno corporativo en el sector bancario español: Relaciones entre las remuneraciones de los directivos y los resultados financieros". Directoras: María Ángeles Fernández y María Jesús Muñoz (Universidad Jaume I). Comentarista: Josep Tribó (Universidad Carlos III de Madrid)
13:15-14:00	Beatriz Martínez. "Cobertura con contratos de futuros en mercados de gas europeos". Director: Hipòlit Torró (Universidad de Valencia). Comentarista: Juan Ángel Lafuente (Universidad Jaume I)
14:00-16:00	Almuerzo

SESIÓN 7. Presidente: Eliseo Navarro (Universidad de Castilla-La Mancha)	
16:00-16:45	María José Huete. "El crédito <i>crunch</i> y la curva de tipos de interés: Un nuevo paradigma". Director: Alfonso Novales (Universidad Complutense de Madrid). Comentarista: Román Ferrer (Universidad de Valencia)
16:45-17:30	Fernanda Díaz. "Assessing Seasonality in Commodity Markets". Directores: Javier Población y Gregorio Serna (Banco de España y UCLM). Comentarista: Ángel Pardo (Universidad de Valencia)
17:30-18:00	Descanso
18:00-18:45	Vicente Medina. "Stylized Facts in CO2 Returns". Directores: Ángel Pardo y María Mansanet (Universidad de Valencia). Comentarista: Isabel Figuerola-Ferretti (Universidad Carlos III de Madrid)
18:45-19:30	Carmen Gisbert. "Modelización de la estructura temporal de los precios de los commodities con escasos datos de mercado". Directores: Javier Población y Gregorio Serna (Banco de España y UCLM). Comentarista: Toni Vaello (Universidad de las Islas Baleares)

21:00 CENA DE CLAUSURA Y ENTREGA DE PREMIOS FUNCAS (HOTEL CARLOS V)

PATROCINAN



WORKSHOP MASTER EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



TOLEDO, 13, 14 Y 15 DE JULIO DE 2009
EDIFICIO SAN PEDRO MÁRTIR
SALA DE ÓCULOS



VNIVERSITAT
ID VALÈNCIA

LUNES, 13 DE JULIO

SESIÓN 1. Presidente: Francisco Climent (Universidad de Valencia)	
16:30-17:15	Naiara Beaskoetxea. “Tipologías de la encuesta financiera de las familias españolas usando el método cluster”. Director: Miguel Ángel Martínez (Universidad del País Vasco). Comentarista: Pedro Gento (Universidad de Castilla-La Mancha)
17:15-18:00	Peio Zuazo. “El índice de riesgo de Foster y Hart: Aplicaciones en Finanzas”. Director: José María Usategi (Universidad del País Vasco). Comentarista: Silvia Mayoral (Universidad Carlos III de Madrid)
18:00-18:30	Descanso
18:30-19:15	Manuel García. “Modelos de Valoración de la viabilidad/solvencia/sostenibilidad financiera de los sistemas de pensiones de reparto”. Director: Carlos Vidal-Meliá (Universidad de Valencia). Comentarista: Francisco Escribano (Universidad de Castilla-La Mancha)
19:15-20:00	Elsa Sáenz. “Análisis empírico de la dinámica de los índices de crédito”. Director: Agustín Martín Calmarza (BBVA). Comentarista: Álvaro Lario (Universidad de Castilla-La Mancha)

MARTES, 14 DE JULIO

SESIÓN 2. Presidente: Gregorio Serna (Universidad de Castilla-La Mancha)	
9:30-10:15	Enrique Salvador. “Modelos de cambios de régimen en volatilidad: Aplicación para la cobertura dinámica del IBEX-35”. Director: Vicent Aragó (Universidad Jaume I). Comentarista: Antonio Rubia (Universidad de Alicante)
10:15-11:00	Alejandro Barrachina. “Multiplicidad e indeterminación del equilibrio financiero: Restricciones a la inversión y utilidad logarítmica generalizada”. Directora: Amparo Urbano (Universidad de Valencia). Comentarista: Jesús Ruiz Andujar (Universidad Complutense de Madrid)
11:00-11:45	Lidia Sanchís. “The Value of Liquidity and Trading Activity in Forecasting Downside Risk”. Director: Antonio Rubia (Universidad de Alicante). Comentarista: Eva Roperó (Universidad Europea de Madrid)
11:45-12:30	Descanso

SESIÓN 3. Presidente: Julio Lucía (Universidad de Valencia)	
12:30-13:15	Fernando Ruiz. “Asset Allocation en presencia de riesgo sistémico”. Director: Ángel León (Universidad de Alicante). Comentarista: David Moreno (Universidad Carlos III de Madrid)
13:15-14:00	Natacha Leal. “Time-varying betas in emerging countries: The Brazilian case”. Directoras: Ainhoa Zarraga y Susan Orbe (Universidad del País Vasco). Comentarista: Belén Nieto (Universidad de Alicante)
14:00-16:00	Almuerzo

SESIÓN 4. Presidente: Cristina Mazón (Universidad Complutense de Madrid)	
16:00-16:45	Jorge Enrique Ruiz Trujillo. “Micro y macro eficiencia del mercado bursátil”. Director: Gregorio Serna (Universidad de Castilla-La Mancha). Comentarista: Gonzalo Rubio (Universidad Cardenal Herrera)
16:45-17:30	Carlos Salvador. “Interacción entre la actividad macroeconómica y el mercado bursátil”. Director: Bernardí Cabrer (Universidad de Valencia). Comentarista: Luana Gava (Universidad Europea de Madrid)

17:30 – 20:00. MERCADO DE TRABAJO
