

X WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS

Univ. de Castilla La Mancha
Univ. del País Vasco

$\alpha/\beta =$ Master en Banca y
Finanzas Cuantitativas

Univ. de València
Univ. Complutense de Madrid

Patrocinado por FUNCAS



Colabora

Cátedra
de Finanzas
Internacionales

UNIVERSITAT
ID VALÈNCIA



MIÉRCOLES 4 DE JULIO 2012

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
16:00		INAUGURACIÓN Iñaki Goirizelaia, Rector de la UPV/EHU		
16:15	CARLOS SANCHEZ-PALENCIA	<i>Identificación de factores determinantes de las Primas de CDS soberanos: Un análisis internacional</i>	Alfonso Novales (UCM)	Toni Vaello (UIB)
16:45	MARÍA PLANAS	<i>Testing for predictive accuracy under different error structures</i>	Eva Ferreira Susan Orbe (UPV/EHU)	Cristina González (UPV/EHU)
17:15	SERGIO DE DIEGO	<i>Cálculo de Malliavin: Aplicación al cómputo de griegas para opciones europeas en el entorno Black-Scholes</i>	Eva Ferreira (UPV/EHU)	Noèlia Viles (BCAM)
17:45	DESCANSO			
18:15	PEDRO ANTONIO DA SILVA	<i>Intertemporal optimal demands for bonds and industry portfolios</i>	Martin Lozano (U Manchester)	Elena Márquez (UCM)
18:45	PATRICIA CANAL	<i>Selección de modelos de regresión con coeficientes cambiantes basada en la capacidad predictiva</i>	Eva Ferreira Susan Orbe (UPV/EHU)	Larraitz Aranburu (UPV/EHU)
19:15	DAVID MARTINEZ	<i>Dinámica de la volatilidad en presencia de estacionalidad</i>	Alfonso Novales Jesus Ruiz (UCM)	Marta Regúlez (UPV/EHU)

JUEVES 5 DE JULIO 2012

9:30	TANIA FUERTES	<i>BFC: Una eficiente metodología en la solución de modelos de optimización estocástica de dos etapas</i>	Araceli Garín (UPV/EHU)	Aitziber Unzueta (UPV/EHU)
10:00	ALEJANDRO TORTOSA	<i>Réplica de índices bursátiles en mercados poco líquidos</i>	Begoña Font (UV)	Alberto Morillo (CONSULNOR)
10:30	DANIEL FUENTES	<i>Aplicación de un modelo de asset allocation dinámico para el mercado europeo</i>	U. Ansejo (ITZARRI) D. Corral (CONSULNOR)	Federico Platanía (UCM)
11:00	DESCANSO			
11:30	ITZIAR GARROTE	<i>Análisis de los comovimientos de las primas de riesgo de los países de la Eurozona</i>	Marta Regúlez (UPV/EHU)	Alessandro Maravalle (UPV/EHU)
12:00	BORIS CASTRO	<i>Aplicación empírica de las medidas mentales y carteras eficientes</i>	Angel León (UA) Martin Lozano (U Manchester)	Luis Vicente (UZ)
12:30	ANTONIO ARGUEDAS	<i>Callable Bonds: estudio empírico de las causas de su emisión</i>	Antonio Diaz (UCLM)	Isabel Abínzano (UPNA)
13:00	TERESA COLLADO	<i>Los efectos de la crisis en el capital buffer</i>	Joaquín Maudos Juan Fernández (UV)	Germán Lopez-Espinosa (UNAV)
13:30	COMIDA			
16:00	JORNADA EMPRESAS	BBVA: José Manuel López y M^a Dolores Hernández	BSCH: François Friggit	

CRF: Jon Loidi

ETS: Fernando Pablos

BBK: Plácido Baña

ITZARRI: Unai Ansejo

ALBIA: Fernando Cabos

18:00 **DESCANSO**

18:30	ANDRES RIVERA	<i>Volatilidad Estocástica - Modelo de Heston</i>	A. Novales (UCM) Angel Leon (UA)	Gonzalo Rubio (CEU)
19:00	RUBEN SANCHEZ	<i>Is VPIN useful in European Markets?</i>	Miguel A. Martínez (UPV/EHU)	Vicente Medina (UV)

VIERNES 6 DE JULIO 2012

9:30	PAULA PARDO	<i>The conditional evaluation of the Colombian Mutual Funds</i>	Miguel A. Martínez (UPV/EHU)	David Moreno (UC3M)
10:00	ANA M ^a RIVERA	<i>Evolución temporal de la frontera media-varianza y su relación con la economía real</i>	Martin Lozano (U Manchester)	Belén Nieto (UA)
10:30	LAURA GARCIA	<i>Estimador Value-at-Risk insesgado en probabilidad</i>	Alfonso Novales (UCM)	Gonzalo García-Donato (UCLM)
11:00	DESCANSO			
11:30	MIGUEL A. RODRIGUEZ	<i>La prima de riesgo de los bonos soberanos</i>	M ^a D. Robles (UCM)	Antonio Moreno (UNAV)
12:00	IKER USOBIAGA	<i>Pricing intra-day options</i>	Enrico Scalas (BCAM)	Ana González (UPNA)
13:30	COMIDA			
16:00	AITOR GARCÍA	<i>Relaciones empíricas entre los precios de contado en los mercados de electricidad de Francia, Italia y Austria</i>	Aitor Ciarreta Ainhoa Zárraga (UPV/EHU)	Pablo Villaplana (CNE)
16:30	JAVIER GARCIA	<i>An Analysis of the Bilateral Counterparty Value Adjustment for Interest Rate Swaps with Stochastic Default Intensities</i>	Alfonso Novales (UCM)	Juan Angel Lafuente (UJI)
17:00	DESCANSO			

CONFERENCIA INVITADA: Crisis in derivatives business François Friggit (BSCH)

21:30 **CENA Y ENTREGA DE PREMIO Cátedra Finanzas Internacionales-Banco Santander de la Universitat de València, Hotel Indautxu, BILBAO**

Lugar de celebración: Bizkaia Aretoa, Auditorio Baroja, Avenida Abandoibarra, 3 BILBAO

DEFINITIVA