

XV WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



Patrocinado por FUNCAS



Univ. de Castilla La Mancha
Univ. del País Vasco

Univ. de Valencia
Univ. Complutense de Madrid

LUNES, 10 DE JULIO 2017

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	INAUGURACIÓN: D^a María Isabel López Solera, Vicerrectora de Docencia, UCLM			
9:15	Marta Landa	Valoración y cobertura de opciones Asiáticas y Australianas sobre subyacente de renta fija: un enfoque basado en modelos con estacionalidad	Manuel Moreno (UCLM)	Alvaro Montealegre (BS)
9:55	Regina Heres	Riesgo de Modelo en la estimación del VaR y CVaR: aplicación a carteras de renta variable y carteras de deuda	Alfonso Novales (UCM)	Javier López (BS)
10:35	Joan Iranzo	European sovereign debt markets: effectiveness of unconventional monetary policy in the zero-lower bound	Pilar Abad (URJC)/Helena Chuliá (UB)	Esther Fernández (UCM)
11:15	Carlos López	Linear and nonlinear relationships between interest rates changes and stock returns: International evidence	Román Ferrer (UV)	Jesús Ruíz (UCM)
11:55	DESCANSO			
12:15	Gema Casanova	¿Anticipan los mercados financieros cambios de rating en carteras de crédito?: Un análisis sectorial	Alfonso Novales (UCM)/Álvaro Chamizo (BBVA)	Dolores Robles (UCM)
12:55	Alberto Roldán	Gestión de carteras de Renta Fija: contexto de tipos de interés negativos	Antonio Díaz (UCLM)/Marta Tolentino (UCLM)	Ana Escribano (UCLM)
13:35	Agustín Pineda	Negative rates in derivatives pricing. Theory and Practice	Manuel Moreno (UCLM)/Gregorio Vargas (EY)	Raquel Bujalance (BS)
14:15	COMIDA			
16:00	Héctor Martínez	Evaluación del modelo de valoración intertemporal con el límite de volatilidad para el factor de descuento como variable de estado	Belén Nieto (UA)	Mari Mar Miralles (UNEX)
16:40	Natalia del Campo	Valoración de derivados sobre productos agrícolas: un enfoque basado en modelos con reversión a la media y estacionalidad	Manuel Moreno (UCLM)	Vicente Medina (REPSOL)
17:20	Ángela Coronado	Testing the reliability of electricity forward price databases	María Dolores Furió (UV)/Francisco Climent (UV)	Fernando Palao (REPSOL)
18:00	Norma A. Bautista	The role of copulas in the characterization of the counterparty credit risk	Martín Lozano (U. Monterrey)	Rubén García Céspedes (BBVA)

MARTES, 11 DE JULIO 2017

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
11:35	Alexandre Fonollosa	Estimación del VaR en carteras de crédito mediante modelos de correlación factorial	Alfonso Novales (UCM) y Álvaro Chamizo (BBVA)	María Planas (ETS)
12:15	Jessica Romera	Wrong Way Risk: efectos en el CVA con distintos modelos de cópulas	Eva Ferreira (UPV/EHU)/Gregorio Vargas (EY)	Fernando de Lope (BBVA)
12:55	Álvaro Gallego	Fuentes de riesgo en carteras de divisas	Alfonso Novales (UCM)	Pilar Abad (URJC)
13:35	Unai Aquesolo	Selección óptima de carteras: ¿es relevante el criterio?	Alfonso Novales (UCM)/Juan Angel Jiménez (UCM)	Tania Fuertes (ETS)
14:15	COMIDA			
16:00	Álvaro Gómez	La volatilidad implícita como predictor del mercado: Evidencia internacional	Alfonso Novales (UCM)	Antonio Rubia (UA)
16:40	Elizabet Atanasova	Pricing and Hedging Fixed Income Derivatives under Negative Interest Rates: An SABR approach	Manuel Moreno (UCLM)/Gregorio Vargas (EY)	Guillermo Serna (BBVA)
17:20	DESCANSO			
17:30	JORNADA EMPRESAS 1: Nfque; PwC, KPMG			

MIÉRCOLES, 12 DE JULIO 2017

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:15	Larisa Cimpean	El uso de expectiles en la medición del riesgo. Comparativa con el VaR y con el ES	Alfonso Novales(UCM)/ Laura García (UCM)	Lidia Sanchís (UCLM)
9:55	Luis Fernández	Negociación por pares: un enfoque mediante cópulas	Óscar Carchano (UV)	Unai Ansejo (INDEXA)
10:35	Sergio Parrado	Valuation of Basket Swap based in a intensity approach: first-to-default and two-first-to-default	Eva Ferreira (UPV/EHU)	Pedro Serrano (UC3M)
11:15	Agustín Piqueres	Performance Measures under Parametric and Semiparametric models. What is the Best Approach?	Angel León (UA)	David Moreno (UC3M)
11:55	DESCANSO			
12:30	CONFERENCIA INVITADA: "MACRO-FINANZAS" Gonzalo Rubio, CEU			
14:00	COMIDA			
16:00	Markel López	Análisis de los determinantes de los tipos de interés bancarios de la Euroárea	Joaquín Maudos (UV)	Carlos Salvador (CUNEF)
16:40	Laura Areizaga	Cambios en la estructura de ingresos en la banca de la OCDE: rentabilidad, riesgo y poder de mercado	Juan Fernández de Guevara (UV)	Óscar Ibáñez (AFI)
17:20	Jennifer Pérez	Indices de volatilidad: un enfoque basado en modelos en tiempo continuo de volatilidad estocástica	Manuel Moreno (UCLM)	Teresa González (CUNEF)
18:00	DESCANSO			
18:15	JORNADA EMPRESAS 2: ETS			
21:30	CENA Y ENTREGA DE PREMIOS			

**Lugar de celebración: Sede FUNCAS, C/ Caballero de Gracia, 28
28013 Madrid**