

WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS 2020

(<https://eu.bbcollab.com/guest/cf3283e443d845059d11e345a8d711af>)

DIA	HORA	ALUMNO	DIRECTOR	TITULO
09-jul	10:00	Celia Fructuoso	Laura García (UCLM)	Transmisión de riesgo entre el petróleo y los índices de mercado BRICS: Un análisis VAR de VaR
09-jul	10:45	Pablo Muñoz	Miguel Angel Martinez (UPV/EHU) Diego Corral (Diaphanum)	Quantilic Beta Portfolios: Una forma alternativa de exponerse al Factor Mercado
09-jul	11:30	Gorka González de Mendivil	José S. Penalva (UC3M)	Modelling stock prices as a discrete self-exciting process: Hawkes vs VAR
09-jul	12:15	Gael Pereira	Jesús Ruiz (UCM)	Predicción y capitalización de las tendencias del mercado bursátil europeo: Comparación de métodos paramétricos y no paramétricos
09-jul	16:00	Angel Barreiro	Unai Ansejo (INDEXA) Janire Herrero (KUTXABANK) Manuel Moreno (UCLM)	Análisis y predicción de entradas y salidas en fondos españoles (2008-2020)
09-jul	16:45	Rubén Monllor	Carlos Salvador (UV) Pedro Cuadros (CUNEF)	Efecto de la regulación sobre el comportamiento de las agencias de rating: evidencia empírica sobre los ratings bancarios
09-jul	17:30	Luis Marin	M ^a Dolores Furió (UV) Hipòlit Torró (UV)	Cobertura óptima con futuros para el mercado nórdico de electricidad, Nord Pool