

$$Q\cdot\int\beta = \frac{\text{MASTER EN BANCA Y}}{\text{FINANZAS CUANTITATIVAS}}$$

## XXIII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Somosaguas, 30 de septiembre y  
2 de octubre de 2025

# XXIII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

30 de septiembre de 2025

[Enlace Teams de esta sesión](#)

**10:00 - 10:45**

*"Pricing plain vanilla options on Henry Hub futures: Introducing a hump-shaped volatility model"*

**Autor:** Luis Berruguete

**Directoras:** Carme Frau (Universitat de les Illes Balears)

M. Dolores Robles (Universidad Complutense de Madrid)

**Comentarista:** Antoni Vaello (Universitat de les Illes Balears)

**10:45 - 11:30**

*"Predicción de Desempleo e IPCA con indicadores de Google Trends y Modelos de Frecuencias Mixtas"*

**Autor:** Víctor Micó

**Director:** Alfredo García (Universidad Complutense de Madrid)

**Comentarista:** Víctor Gonzalo (Universidad Complutense de Madrid)

**11:45 - 12:30**

*"El impacto de la banca a la sombra sobre la estabilidad bancaria"*

**Autor:** Daniel Pérez

**Director:** Carlos Salvador (Universitat de València)

**Comentarista:** Pedro Cuadros (CUNEF)

# XXIII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

30 de septiembre de 2025

[Enlace Teams de esta sesión](#)

**15:45 - 16:30**

*"Diversificación de la riqueza de los hogares españoles: un análisis con la Encuesta Financiera de las Familias"*

**Autora:** Esther María Guijarro

**Directora:** Arantza Gorostiaga (Universidad del País Vasco, UPV/EHU)

**Comentarista:** Manuel Verdú (Universitat de València)

**16:30 - 17:15**

*"European option pricing under mixed fractional Brownian motion: spot and futures based valuation"*

**Autor:** Jesús Ábalo

**Director:** Manuel Domínguez (Universidad Complutense de Madrid)

**Comentarista:** Iván Blanco (CUNEF)

# XXIII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

## 2 de octubre de 2025

[Enlace Teams de esta sección](#)

**09:30 - 10:15**

*"ESG Connectedness: A European study by sector"*

**Autor:** Alejandro Mateo

**Directores:** Francisco Jareño (Universidad de Castilla-La Mancha)  
Ana M. Escribano (Universidad de Castilla-La Mancha)

**Comentarista:** Román Ferrer (Universitat de València)

**10:15 - 11:00**

*"Impacto de los anuncios de emisión de bonos ESG en el riesgo de crédito de mercados emergentes"*

**Autora:** Ángela Ramón

**Directora:** Laura Ballester (Universitat de València)

**Comentarista:** Francisco Jareño (Universidad de Castilla-La Mancha)

**11:00 - 11:45**

*"Determinantes socioeconómicos del cierre de oficinas bancarias en los municipios españoles durante el periodo 2014–2022"*

**Autor:** Carles Cerdà

**Directora:** Paula Cruz (Universitat de València)

**Comentarista:** Alicia Gómez (Universitat de València)

# $Q\cdot f\cdot \beta =$ MASTER EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS

## XXIII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Somosaguas, 30 de septiembre y  
2 de octubre de 2025

### Sede

Instituto Complutense Análisis  
Económico - ICAE  
Aula N101  
Campus de Somosaguas - UCM

Patrocinado por

