

**PROGRAMA XXII WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS
CUANTITATIVAS. ·30 de septiembre – 2 de octubre de 2024.**

Lunes 30 de septembre (https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3ameeting_M2UxMmI5MTYtOWQ0OC00M2Y1LWE0NjAtNjZjOWJiOGY4YjM0%40thread.v2/0?context=%7b%22id%22%3a%2283c2d98e-37ae-46c5-a435-b7f2d378a5fe%22%2c%22oid%22%3a%226b077214-e1f4-495c-9b07-64657f968e8f%22%7d)

12:00-12:45

Título: "Climate change effects on economic growth"

Autora: Igone Ruiz Tellería

Directores: Juan Ángel Jiménez (UCM) y Dolores Robles (UCM)

Comentarista: Ana Rosa Martínez Cañete (UCM)

Tribunal: Pilar Soriano (UV), Ainhoa Zarraga (UPV), Esther Fernández (UCM)

Lugar: Aula B010. Facultad de Economía y Empresa, Universidad del País Vasco/Euskal Herriko Unibertsitatea

12:45-13:30

Título: “Integrating LSTM price prediction with performance criteria for portfolio optimization: an empirical study on the ibex-35 market”

Autor: Jorge Santibáñez Escartin

Directores: Alfredo García Hiernaux (UCM) y Ángel León (UA)

Comentarista: Patrizia Pérez Asurmendi (UCM)

Tribunal: Rafael Benítez (UV), Antonio Díaz (UCLM), Arantza Gorostiaga (UPV/EHU)

Lugar: Aula B010. Facultad de Economía y Empresa, Universidad del País Vasco/Euskal Herriko Unibertsitatea

13:30-14:15

Título: “Cálculo del Valor Temporal de Opciones y Garantías (TVFOG) en Contratos de Seguros”

Autor: Rubén Ferreiro Arias

Directores: Eloy Jesús Pozo (Deloitte) y Esther Fernández (UCM)

Comentarista: Rodrigo Ferreras (Comisión Europea)

Tribunal: Juan Nave (UCLM), Dolores Robles (UCM), Hipòlit Torró (UV)

Lugar: Sala N-101 del Instituto Complutense de Análisis Económico (Campus de Somosaguas)

Martes 1 de octubre (https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3ameeting_N2M2ZWM3MWYtYWU1MS00ZjA2LWEzOWMtMjE3Mzk5NzI5OTE1%40thread.v2/0?context=%7b%22Tid%22%3a%2283c2d98e-37ae-46c5-a435-b7f2d378a5fe%22%2c%22Oid%22%3a%226b077214-e1f4-495c-9b07-64657f968e8f%22%7d)

13:00-13:45

Título: “News shocks en modelos DSGE”

Autor: Salvador Brines Mirón

Director: Jesús Vázquez (UPV/EHU)

Comentarista: José E. Boscá (UV)

Tribunal: Juan Fernández de Guevara (UV), Laurentiu Guinea (UCM), Jesús Ruiz (UCM)

Lugar: Sala N-101 del Instituto Complutense de Análisis Económico (Campus de Somosaguas)

Miércoles 2 de octubre (https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3ameeting_ZTEzNzMyZmMtODczNy00NDRmLTgxMDgtYzk2YTc0ODNmZTdi%40thread.v2/0?context=%7b%22Tid%22%3a%2283c2d98e-37ae-46c5-a435-b7f2d378a5fe%22%2c%22Oid%22%3a%226b077214-e1f4-495c-9b07-64657f968e8f%22%7d)

10:00-10:45

Título: “Short-Term Variance Risk Premium Term Structure: Analysis and Sources”

Autor: Eukén Maiz Martínez

Director: Juan Miguel Londoño (Reserva Federal)

Comentarista: Teresa González (Banco de España)

Tribunal: Francisco Climent (UV), Aitor Ciarreta (UPV/EHU), Manuel Moreno (UCLM)

Lugar: Aula B010. Facultad de Economía y Empresa, Universidad del País Vasco/Euskal Herriko Unibertsitatea

10:45-11:30

Título: “Modelización y Predicción de Precios del Mercado Eléctrico Español: Aplicación de modelos ARIMAX-GARCHX”

Autor: Pablo Salaberri Lasa

Director: Aitor Ciarreta (UPV/EHU) y Ainhoa Zarraga (UPV/EHU)

Comentarista: Rebeca Jiménez (USAL)

Tribunal: Dolores Furió (UV), Jesús Ruiz (UCM), Javier García (UPV/EHU)

Lugar: Aula B010. Facultad de Economía y Empresa, Universidad del País Vasco/Euskal Herriko Unibertsitatea