

XIX WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS

$$q\beta = \frac{\text{Master en Banca y}}{\text{Finanzas Cuantitativas}}$$

Univ. de Castilla La Mancha
Univ. del País Vasco

Univ. de Valencia
Univ. Complutense de Madrid

MIÉRCOLES, 7 DE JULIO 2021

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A
9:00	<u>Runfeng Yang</u>	<i>Deconstructing ESG Impact – A Factor-based Approach</i>	Juan Angel Jimenez (UCM)
9:45	Paula Maudos	<i>Dependence between green investments and conventional asset classes: A quantile coherency perspective</i>	Román Ferrer (UV)
10:30	Jesúa López	<i>Systemic Risk transmission in European Sectoral CDS using Bayesian Networks</i>	Laura Ballester y José Manuel Pavia (UV)
DESCANSO			
12:00	Oscar Bernardos	<i>Modelling Prices in Solar and Wind Long-Term PPA</i>	Juan Ignacio Peña (UC3M)
12:45	Alejandro Torres	<i>Transformación wavelet, modelos SARIMA y GARCH para la predicción de precios diarios de electricidad</i>	Ainhoa Zarraga y Aitor Ciarreta (UPV/EHU)
COMIDA			
15:00	Carolina Rodrigo	<i>Driving Factors Behind Global Systemic Risk</i>	Eva Ferreira y Susan Orbe (UPV/EHU)
15:45	Beatriz de la Flor	<i>Exchange rate, that great forgotten</i>	Eva Ferreira y Javier Ojea (UPV/EHU y CNMV)
16:30	Martin Vivó	<i>Assessing the effect of the uncertainty on exchange rates: a Quantile regression approach</i>	Helena Chuliá y María del Pilar Abad (UB y URJC)
17:15	Javier Miranda	<i>Economías de Escala en el Sector Bancario: ¿Cuánto ahorro en costes permite el tamaño?</i>	Juan Fernández (UV)

Lugar de celebración: BBC <https://eu.bbcollab.com/guest/6695ccce4bd24a56a17b886f782a62bd>