

XXI WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



Univ. de Castilla La Mancha
Univ. del País Vasco/Euskal Herriko Unib.

Univ. de València
Univ. Complutense de Madrid

MARTES, 4 DE JULIO 2023

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
10:00 - 10:45	Isabel Martínez	Predicting and explaining Spanish companies bankruptcy using Machine Learning	Rubén García-Céspedes (BBVA) y Manuel Moreno (UCLM)	Ignacio Segarra (ICADE)
10:45 - 11:30	Diana Mykhalyuk	Resilience of Spanish mutual funds to climate transition shocks	Manuel Moreno (UCLM) y Javier Ojea (Bank of Canada)	Albert Martínez (CNMV)
DESCANSO				
12:00 - 12:45	Miguel López	Liquidity dynamics and regulatory oversight in Over-the-Counter markets: Exploring market quality and firm positioning	Patrizia Pérez Asurmendi (UCM)	David Abad* (UA)
12:45 - 13:30	Ane Alvarez	Equity Asian rainbow options: A pricing and sensitivity analysis based on mean-reverting seasonal interest rate models	Manuel Moreno (UCLM)	Belén León-Pérez (Quant AI Lab)
COMIDA				
15:30 - 16:15	Zechao Li	Evaluación del riesgo de cola para estrategias de inversión sostenibles: Un enfoque de optimización dinámica de carteras	Antonio Díaz y Carlos Esparcia (UCLM)	Ana Escribano* (UCLM)
16:15 - 17:00	Adrián García	Equity barrier options pricing and sensitivity analysis in a scenario of mean-reverting seasonal interest rates	Manuel Moreno (UCLM)	Alberto Bueno-Guerrero* (IES Francisco Ayala)
DESCANSO				
17:15 - 18:00	Jorge Meliá	Neural network models based on Montecarlo simulation for valuation and credit risk adjustment of financial derivatives	Alicia Ponce Ortiz, Iñaki Ramos García y Luis Manuel García Muñoz (BBVA)	Jesúa López

MIÉRCOLES, 5 DE JULIO 2023

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:30 - 10:15	José Fons	Differential Machine Learning for derivative pricing and its applications	Eugenio Martín Gallego (BBVA)	Rubén García-Céspedes* (BBVA)
10:15 - 11:00	Javier Moreno	Elasticidad precio-demanda del mercado eléctrico español	Dolores Furió (UV)	Aitor Ciarreta (UPV/EHU)
11:00 - 11:45	Enrique Puente	Hybrid DCC-GARCH-LSTM covariance matrix forecasting model: An application to portfolio volatility	Jesús Ruíz (UCM)	Carles Bretó (UV)
DESCANSO				
12:15 - 13:00	Lucía García	Financial management of climate risk in Europe	Pilar Soriano (UV)	Javier Ojea* (Bank of Canada)
13:00 - 13:45	David Blesa	Pricing CoCos and barrier options in a mixed fractional Brownian motion environment	Manuel Domínguez (UCM)	Elisa Alós (UPF)

Si el nombre del comentarista aparece con asterisco, quiere decir que su intervención será online.

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

La dirección para seguir las presentaciones online es [ésta](#).
ID de la reunión: 367 680 577 664 Código de acceso: A77PCF