

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

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Madrid, 8 y 9 de julio de 2024

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

8 y 9 de julio de 2024

Lunes 8 de julio ([enlace Teams](#))

10:00 - 10:45

"Do ESG scores produce better performance? Evidence from Latin America"

Autor: Sean Kelly

Directora: Pilar Soriano (Universitat de València)

Comentarista: Alberto Roldán (KPMG)

10:45 - 11:30

"Análisis de la conectividad, causalidad y ratio de cobertura de diversas medidas de incertidumbre con el bono verde"

Autor: Fengyu Lin

Director: Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Luis Puch (Universidad Complutense de Madrid)

12:00 - 12:45

"Age, time and cohort effects on the asset allocation of European households' portfolios"

Autora: Janire Tapia

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

Comentarista: Ricardo Gimeno (Banco de España)

12:45 - 13:30

"Efectos asimétricos de los componentes anticipados del sector bancario global sobre el sector bancario de México, Brasil y España"

Autor: Gonzalo Torres

Directores: Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Javier Pérez (Banco de España)

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

8 y 9 de julio de 2024

Lunes 8 de julio ([enlace Teams](#))

15:30 - 16:15

"Assessing the diversifying role of real estate across asset classes: a performance and downside risk analysis"

Autor: Javier Gamboa

Directores: Antonio Díaz (Universidad Castilla-La Mancha)

Carlos Esparcia (Universidad Castilla-La Mancha)

Comentarista: Edurne Uribe (Laboral Kutxa)

16:15 - 17:00

"A study of the Rough Quadratic Heston applied on the EUROSTOXX 50 index"

Autor: Javier Manero

Director: Manuel Domínguez (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Gorka González (Banco de Santander)

17:30 - 18:15

"Deconstructing ESG premiums: An industrial approach"

Autor: Eneko García

Director: Juan Ángel Jiménez (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Juan Rodríguez (London Stock Exchange Group)

18:15 - 19:00

"Variability in risk weighted assets: On the relevance of credit risk and macro-financial variables"

Autora: Nerea Pérez

Directores: Juan Carlos García-Céspedes (KPMG)

Rubén García-Céspedes (BBVA)

Manuel Moreno (Universidad Castilla-La Mancha)

Comentarista: Iban Hidalgo Pérez-Sevilla (Banco Santander)

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

8 y 9 de julio de 2024

Martes 9 de julio ([*enlace Teams*](#))

10:00 - 10:45

"Realized volatility y Value-at-Risk: ganancia en precisión de la predicción de modelos GARCH y GAS"

Autor: Iván Rodríguez

Director: Carles Bretó (Universitat de València)

Comentarista: Concepción Ausín (Universidad Carlos III de Madrid)

10:45 - 11:30

"Performance and net subscriptions of investment funds with sustainability attributes: An analysis following the introduction of the EU SFDR regulation"

Autor: Jon López

Director: Víctor Gonzalo (Universidad Complutense de Madrid y
Economica-Consortia)

Comentarista: Unai Ansejo (Indexa)

12:00 - 12:45

"Explosiveness in the renewable energy equity sector: international evidence"

Autor: Juan Ariza

Director: Román Ferrer (Universitat de València)

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

12:45 - 13:30

"Causas de la baja rentabilidad de los sectores bancarios europeos frente al estadounidense"

Autor: Sergio García

Director: Juan Fernández de Guevara (Universitat de València)

Comentarista: Nuria Suárez (Universidad Autónoma de Madrid)

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

8 y 9 de julio de 2024

Martes 9 de julio ([enlace Teams](#))

15:30 - 16:15

"A shot noise model with stochastic volatility"

Autor: Miguel Ángel Cerezo

Director: Manuel Domínguez (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Ignacio Fernández (Banco Santander)

16:15 - 17:00

"Reacción del mercado de CDS europeo a los anuncios de emisión de bonos verdes soberanos"

Autora: Alba García

Directoras: Laura Ballester (Universitat de València)

Ana González-Urteaga (Universidad Pública de Navarra)

Comentarista: Fernando Palao (Caixabank)

17:15 - 18:00

"Una mirada alternativa a la estimación de Recovery Rates. Análisis de sensibilidad y aplicación a mercado"

Autor: Sergio Matiz

Director: Jonathan Salgado (Banco Santander)

Comentarista: Alejandro Hu (Abanca)

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

XXII Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Madrid, 8 y 9 de julio de 2024

Sede
FUNCAS
Caballero de Gracia, 28
Madrid

Patrocinado por

