

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

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Madrid, 6 y 7 de julio de 2026

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

6 de julio de 2026

[enlace Teams](#)

10:00 - 10:45

"Determinantes Macro-Financieros de la Estructura Temporal de la Prima de Riesgo del Mercado: De las Fricciones de Corto Plazo a los Fundamentos Estructurales"

Autor: Miguel Cuesta

Directores: Agueda Madoz (Universidad del País Vasco, EHU)

Alberto Morillo (Fineco)

Antoni Vaello (Universitat de les Illes Balears)

Comentarista: Roberto Knop (Tradition y Afi Global Education)

11:00 - 11:45

"Pricing Average Equity Futures Options Under Mixed Fractional Brownian Motion: A Martingale Approach"

Autor: Rodrigo Salort

Directores: Manuel Domínguez (Universidad Complutense de Madrid)

Manuel Moreno (Universidad Castilla-La Mancha)

Comentarista: Elisa Alòs (Universitat Pompeu Fabra)

12:00 - 12:45

"Same Shocks, Different Responses: A Mean Field Game for Liquidity Buffers with Common Jumps and Heterogeneous Congestion"

Autor: Miguel Debón

Directores: Eva Ferreira (Universidad del País Vasco, EHU)

Javier Ojea (Bank of Canada)

Comentarista: Alexandra Matyunina (Banco de España)

13:00 - 13:45

"Credit Risk Opacity, Investor Attention, and Stock Price Synchronicity"

Autora: Fabiola Quirós

Directoras: Pilar Abad (Universidad Rey Juan Carlos)

M. Dolores Robles (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Ana María Escribano (Universidad de Castilla-La Mancha)

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

6 de julio de 2026
[enlace Teams](#)

15:30 - 16:15

"Conectividad Cuantílica en el Mercado Europeo: Impacto Asimétrico de la Incertidumbre"

Autora: Paula Pérez

Directoras: Jone Ascorbebeitia (Universidad del País Vasco, EHU)

Susan Orbe (Universidad del País Vasco, EHU)

Comentarista: Javier Ojea (Bank of Canada)

16:30 - 17:15

"Low-Frequency Liquidity Measures: A Horse-Race for European Markets"

Autor: Antón Salvadores

Directores: David Abad (Universidad de Alicante)

José Yagüe (Universidad de Murcia)

Comentarista: José Penalva (Universidad Carlos III de Madrid)

17:15 - 18:00

"A Noise-Aware Quantum Algorithm For Credit Valuation Adjustments on Real Quantum Hardware"

Autor: Guillem Borràs

Directores: Luis de Pedro (Universidad Autónoma de Madrid)

Francisco Gómez (BBVA)

Comentarista: Álvaro Díaz (BBVA)

18:00 - 18:45

"Pricing American Options with Reinforcement Learning and Numerical Methods: A Comparative Study"

Autor: Gonzalo Moll

Director: Telmo Pérez- Izquierdo (Universidad del País Vasco, EHU)

Comentarista: Guillermo Serna (BBVA)

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

7 de julio de 2026

[enlace Teams](#)

10:00 - 10:45

"News Shocks in the Oil Market: An Asymmetric and Regime-Dependent Analysis of the Carbon Market and the Green Economy"

Autor: Johannes Felchner

Director: Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Víctor Gonzalo (Economica Consortia y UCM)

11:00 - 11:45

"Comparing Financial Return Distributions Using the Fisher Information Metric of Time Series Models"

Autor: Alfonso San Miguel

Directores: Manuel M. Cuerno (Cunef)

Telmo Pérez- Izquierdo (Universidad del País Vasco, EHU)

Comentarista: Andrés Ahumada (Cunef)

12:15 - 13:00

"Optimización de Carteras Smart Beta: Gestión del Riesgo Asimétrico y Clustering Jerárquico en la Asignación de Activos"

Autor: Alejandro Martínez

Director: Ángel León (Universidad de Alicante)

Comentarista: David Moreno (Universidad Carlos III de Madrid)

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

7 de julio de 2026
[enlace Teams](#)

17:30 - 18:15

"Modelling Geopolitical Risk in Default Probability"

Autor: Joel Soler

Directores: Jorge Meliá (KPMG), Enrique Puente (KPMG)
Manuel Moreno (Universidad de Castilla-La Mancha)
Alberto Roldán (KPMG)

Comentarista: Alejandro Hu (Abanca)

18:30 - 19:15

"Restricciones al Short-Selling y Oportunidades de Arbitraje en la Paridad Acción-ADR"

Autor: Mario Bartels

Directores: Óscar Carchano (Universitat de València)
Manuel Verdú (Universitat de València)

Comentarista: Vicente Medina (Repsol)

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

XXIV Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Madrid, 6 y 7 de julio de 2026

Sede
FUNCAS
Caballero de Gracia, 28
Madrid

Patrocinado por

