

XVI WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



Patrocinado por FUNCAS



Univ. de Castilla La Mancha
Univ. del País Vasco

Univ. de Valencia
Univ. Complutense de Madrid

LUNES, 9 DE JULIO 2018

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:15	INAUGURACIÓN: D. Josu Sangroniz, Director de Estudios de Posgrado UPV/EHU			
9:30	Alejandro Hu	Valoración de opciones americanas sobre el VIX mediante el método de <i>Least-Squares Monte Carlo</i>	Manuel Moreno (UCLM)	Tomás Pérez (BS)
10:15	Patricia Suárez	Valoración de derivados sobre subyacente de renta fija mediante modelos estacionales: una aplicación a opciones <i>look-back</i> y <i>barrera</i>	Manuel Moreno (UCLM)	Samuel Jiménez (BS)
11:00	Mengjue Lu	Generalización del modelo de difusión con saltos de efecto transitorio para el caso de intensidad de saltos no constante con aplicaciones a valoración de derivados	Manuel Domínguez (UCM)	Dani Bacaicoa (AEQ Energía)
11:45	DESCANSO			
12:15	Alexandra Balado	Valoración de futuros sobre permisos de emisión de CO ₂ : análisis empírico y predicción	Manuel Moreno (UCLM)	Pablo Villaplana (OMIClear)
13:00	CONFERENCIA INVITADA: "Bitcoins y Blockchain: la insólita utilidad de las matemáticas inútiles" Josu Sangroniz (Director de Estudios de Posgrado UPV/EHU)			
13:45	COMIDA			
16:00	Jinxia Li	Valoración de opción put americana en el modelo de Merton de difusión con saltos	Lucas Jódar y Rafael Company (UPV)	Borja Montealegre (KPMG)
16:45	Cristina Mata	¿Funciona financieramente el Bitcoin?	Fernando Palao y Vicente Medina (REPSOL)	Pedro Cuadros (CUNEF y FUNCAS)
17:30	DESCANSO			
17:45	JORNADA EMPRESAS 1:			

MARTES, 10 DE JULIO 2018

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
11:30	Alejandro Álvarez	Pairs trading: Optimal threshold strategies	Federico Platania (Pôle Univ. Léonard de Vinci, Paris)	Oscar Carchano (UV)
12:15	Yolanda Buendía	Predicción de riesgo sistémico: Una aproximación de segundo orden del Marginal Expected Shortfall	Laura García (UCLM)	Lidia Sanchís (UCLM)
13:00	Tania Vásquez	Conexiones entre el mercado financiero chino y los mercados internacionales	M ^a Dolores Robles (UCM)	Laura Ballester (UV)
13:45	COMIDA			
16:00	Javier Romero	Crisis financiera y comportamiento de los ratings soberanos	Carlos Salvador y Pedro Cuadros (CUNEF)	Javier Carrasco (BS)
16:45	Javier Ancochea	Conectividades en el sistema financiero europeo	Jesus Ruíz y Javier Ojea (UCM)	Javier Pérez (BdE)
17:30	Iván Hernández	Design and implementation of a Montecarlo simulation engine under a LGM framework: pricing CVA of Interest Rate Swaps	Javier García, Fernando de Lope y Luis Manuel García (BBVA)	Raquel Bujalance (BS)
18:15	Jesús Fernández	Modelización y predicción del ES en el mercado de commodities utilizando EVT condicional	Laura García (UCLM)	Rubén García (BBVA)

MIÉRCOLES, 11 DE JULIO 2018

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:30	Ken Olmedilla	Implications of using (non-rational) expectations of professional forecasters in DSGE modelling	Jesús Vázquez (UPV/EHU)	Pablo Aguilar (BdE)
10:15	Javier Bosca	Predicción del spread On-Off Brasileño mediante modelos paramétricos y combinación de predicciones	Hipòlit Torró (UV)	Sonia Benito (UNED)
11:00	Gracia Esteve	El mercado eléctrico español y su interconexión con el mercado eléctrico alemán	Eva Ferreira (UPV/EHU) y M ^a Dolores Furió (UV)	Cristina Pizarro (UPV/EHU y BC3)
11:45	DESCANSO			
12:30	CONFERENCIA INVITADA: "La Unión Bancaria: arquitectura institucional" Juan Ayora (Senior financial expert en Single Resolution Board, SRB)			
14:00	COMIDA			
16:00	Antonio Rodríguez	Diseño de carteras óptimas con derivados medioambientales: un enfoque basado en cópulas	Manuel Moreno (UCLM)	Carlos González-Pedraz (BdE)
16:45	Sergio Díaz	Predicción sobre salidas de depósitos. Una aplicación práctica de las redes neuronales recurrentes.	Raquel Bujalance y Eva Rodrigo (BS)	Jorge Gascón (BBVA)
17:30	DESCANSO			
18:00	JORNADA EMPRESAS 2: ETS			
22:00	CENA Y ENTREGA DE PREMIOS			

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