

XVII WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS


 = Master en Banca y Finanzas Cuantitativas

Patrocinado por 

Univ. de Castilla La Mancha
 Univ. del País Vasco

Univ. de Valencia
 Univ. Complutense de Madrid

LUNES, 8 DE JULIO 2019

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
11:45	Juan Alba	Valoración en mercados eléctricos mediante modelos con reversión a la media y estacionalidad	Manuel Moreno (UCLM)	Carlos González Pedraz (BdE)
12:30	Antonio Calleja	Estimación de indicadores de la estabilidad del sistema financiero mediante distribuciones EVT multivariantes	Laura García (UCLM)	Lidia Sanchís (UCLM)
13:15	Manuel Verdú	Eficiencia en los mercados en ampliaciones de capital de empresas españolas	Oscar Carchano (UV)	Ana Ibáñez (UV)
14:00	COMIDA			
16:00	Alejandra Lloret	Interest Rate Volatility Risk under FRTB	Carlos Catalán (BS)	Jonathan Salgado (KPMG)
16:45	Miguel Romero	Variable importance in linear regression models versus random forest. Analysis over consumer loans prepayment rates	Raquel Bujalance y Eva Rodrigo (BS)	Ángel Rodríguez (BS)
17:30	Eugenio Martín	Analysis of SABR Calibration with Neural Networks. An Application to the Swaption Smile	Javier García, Fernando de Lope y Luis Manuel García (BBVA)	Raquel Bujalance (BS)
18:15	Pedro Fernández	On the performance of backtesting procedures for expected shortfall	Angel León y Juan Mora (UA)	Rubén García Céspedes (BBVA)

MARTES, 9 DE JULIO 2019

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
11:00	Ferrán Fuster	Numerical solution of American option pricing problems under stochastic volatility	Lucas Jodar y Rafael Company (UPV)	Miguel Angel López-Marcos (UVA)
11:45	Jorge Peris	Modelos Hull-White de derivados sobre tipos de interés: Solución Numérica y Análisis	Lucas Jodar y Rafael Company (UPV)	Julia Martínez (UVA)
12:30	Edurne Uribe	On the sensitivity and CVA of Inflation-Indexed Swaps	Eva Ferreira(UPV/EHU) y María José Rodríguez (LABORALKUTXA)	Guillermo Serna (BBVA)
13:15	Jairo Sánchez	El mecanismo de transmisión de tipos de interés en la Eurozona: 2000-2018	Ximo Maudos (UV)	Carlos Salvador (UV)
14:00	COMIDA			
16:00	Fernando Zubero	The influence of Political Uncertainty on Market Volatility	Eva Ferreira y Susan Orbe (UPV/EHU)	Teresa González (CUNEF)
16:45	Nuria Fuentes	Impacto del output floor en modelos internos de riesgo de mercado	Antonio Díaz (UCLM)	Roberto Bernejo (CNMV)
17:30	David Tarín	Análisis de la Paridad Put-Call en el Mercado Europeo de Derechos de Emisión sobre CO ₂	Fernando Palao y Vicente Medina (REPSOL)	Beatriz Martínez (UV)
18:15	Marta Roig	Is the leadership of the Brent-WTI oil futures market threatened?	Angel Pardo (UV) y Fernando Palao (REPSOL)	Vicente Medina (REPSOL)

MIÉRCOLES, 10 DE JULIO 2019

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	José F. Ospino	Improving pairs trading using neural network techniques and fundamental ratios	Oscar Carchano (UV) y Luis Fernández Payeras (CEPSA)	Javier García (UPV/EHU)
9:45	Alejandro Olmos	How the public attention to global warming affects crude oil shocks - wavelet analysis	Federico Platania (Pôle Univ. Léonard de Vinci, Paris)	Unai Ansejo (INDEXA)
10:30	Ignacio Fernández	Modelo de difusión con saltos de efecto transitorio y volatilidad estocástica	Manuel Domínguez (UCM)	Dani Bakaikoa (AEQ Energía)

11:15	DESCANSO			
11:45	Paula Mollá	The Investment Performance of US Islamic Mutual Funds	Pilar Soriano (UV)	Ana Carmen Díaz (UR)
12:30	Gloria Pilar Garrido	S0ocially Responsible Ratings: An event study	Antonio Díaz (UCLM)	Pilar Abad (URJC)
13:15	Julen Galíndez	The impact of climate change debate on the agricultural commodity market: A wavelet coherence analysis	Federico Platania(Pôle Univ. Léonard de Vinci, Paris)	Josué Polanco (UPV/EHU)
14:00	COMIDA			
16:00	Julián Arce	Arbitrage Free SABR: Partial Differential Equation Approach to Fix Negativity Density Function Issue	Manu Moreno (UCLM) y Gregorio Vargas (Nfoque)	Sandra González (BME)
16:45	Alejandro Garzón	An updated model implementation for Incremental Risk Charge	Hipòlit, Javier Ojea y Gregorio Vargas	Enrique Reina (BdE)
17:30	Jesús Clausi	Valoración de opciones exóticas americanas sobre el VIX mediante el método Least-Squares Monte Carlo	Manuel Moreno (UCLM)	Alvaro Montealegre (REPSOL)
18:15	Guillermo Corredor	Markovian Heath-Jarrow-Morton: Valuation of Interest Rate Derivatives in a Two-Factor Cheyette Gaussian model	Manu Moreno (UCLM) y Gregorio Vargas (Nfoque)	David Castaño (KPMG)
22:00	CENA Y ENTREGA DE PREMIOS			

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