

XX Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

29 de septiembre de 2022

9:30 - 10:15

"Rentabilidad y persistencia de fondos activos e indexados comercializados en España"

Autor: Iván Abellán

Directores: Unai Ansejo (Indexa) y Carlota Corral (Indexa)

Comentarista: Pedro J. Cuadros (CUNEF)

10:15 - 11:00

"International evidence of conditional five factor asset pricing model"

Autor: Jorge L. Hernández

Directores: Javier Ojea (Bank of Canada)

Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Lidia Sanchís (Universidad de Castilla-La Mancha)

11:00 - 11:45

"Liquidity Risk: Studying the resilience of Spanish investment funds to redemption shocks"

Autor: Julián Kost

Director: Andrés Mora (Universidad de los Andes)

Comentarista: David Moreno (Universidad Carlos III de Madrid)

12:15 - 13:00

"Arbitraje en mercados con movimiento browniano fraccional"

Autor: Xabier Cillero

Directores: Manuel A. Domínguez (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Gerardo Oleaga (Universidad Complutense de Madrid)

13:00 - 13:45

"Volatility transmission in the CO2 and energy markets during the EU ETS Phase III"

Autor: Pablo Etxebarria

Directora: Pilar Soriano (Universitat de València)

Comentarista: Fernando Palao (Caixabank)

XX Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

29 de septiembre de 2022

16:00 - 16:45

"Análisis de Conectividad de los mercados energéticos y bursátiles en tiempos del Covid-19"

Autor: Patricia Lachiondo

Director: Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Isabel Figuerola (ICADE)

16:45 - 17:30

"Efectos del Brexit en la transmisión de riesgos en los mercados cambiarios y bursátiles y sobre la economía real"

Autor: Jennifer Chica

Directores: Rafaela Pérez (Universidad Complutense de Madrid)

Jesús Ruiz (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Ioannis Paraskevopoulos (ICADE)

17:30 - 18:15

"Impacto del SSM sobre el riesgo de crédito en el sistema bancario europeo"

Autor: Ana García

Director: Carlos Salvador (Universitat de València)

Comentarista: Rubén García (BBVA)

18:15 - 19:00

"¿Afecta el nivel de opacidad a la respuesta de los rendimientos de los bancos a los resultados de las pruebas de estrés?"

Autor: Marcos Cañego

Directoras: Pilar Abad (Universidad Rey Juan Carlos)

Lola Robles (Universidad Complutense de Madrid)

Comentarista: Amparo Nagore (Universitat de València)

Sede:

Universidad Complutense de Madrid

Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales

Aula N101 - Pabellón de 1er curso (Prefabricado)

Google Meet: <https://meet.google.com/pge-pamp-qsh>