

# Q.F.β = $\frac{\text{MASTER EN BANCA Y}}{\text{FINANZAS CUANTITATIVAS}}$

## XX Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

Madrid, 5 y 6 de julio de 2022

# XX Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

5 y 6 de julio de 2022

## Martes, 5 de julio

**15:45 - 16:30**

*"Fixed-income discrete-time Asian and Australian options: a pricing and hedging approach based on mean-reverting and seasonal models"*

**Autora:** Belén León

**Director:** Manuel Moreno (Universidad Castilla-La Mancha)

**Comentarista:** Esteban Parrado (Quant AI Lab - QRR)

**16:30 - 17:15**

*"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)

**17:30 - 18:15**

*"Monotonicity in Machine Learning models: an application to credit risk"*

**Autor:** Ignacio Segarra

**Directores:** Rubén García (BBVA)

Manuel Moreno (Universidad Castilla-La Mancha)

**Comentarista:** Jonathan Salgado (KPMG)

**18:15 - 19:00**

*"Impact of climate transition risk on the credit profile of SMEs"*

**Autora:** Amaia Gerekiz

**Directores:** Javier Ojea (JRC and ICAE)

Eva Ferreira (UPV/EHU)

María José Rodríguez (Laboral Kutxa)

**Comentarista:** Rubén García (BBVA)

**19:00 - 19:45**

*"Pricing precious metals derivatives: a mean-reverting and seasonal approach"*

**Autor:** Christian Goransson

**Director:** Manuel Moreno (Universidad Castilla-La Mancha)

**Comentarista:** Vicente Medina (Repsol)

# XX Workshop en Banca y Finanzas Cuantitativas

5 y 6 de julio de 2022

## Miércoles, 6 de julio

**12:00 - 12:45**

*“Rentabilidad y persistencia de fondos activos e indexados comercializados en España”*

**Autor:** Iván Abellán

**Director:** Unai Ansejo (Indexa)

**Comentarista:** Pedro J. Cuadros (CUNEF)

**12:45 - 13:30**

*“Nueva metodología de contraste para verificar la validez de modelos aproximados en el cálculo de medidas de riesgo de mercado”*

**Autor:** María González

**Directores:** Eulogio Cuesta (Banco de Santander)

Francisco Sánchez (Banco de Santander)

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

**13:30 - 14:15**

*“Opacidad sobre el riesgo de crédito y atención del inversor”*

**Autor:** Miguel García

**Directoras:** Pilar Abad (Universidad Rey Juan Carlos)

Lola Robles (Universidad Complutense de Madrid)

**Comentarista:** Raquel Bujalance (Banco de Santander)

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

**XX Workshop en  
Banca y Finanzas Cuantitativas**

Madrid, 5 y 6 de julio de 2022

**Sede**  
FUNCAS  
Caballero de Gracia, 28  
Madrid

Patrocinado por

