

II WORKSHOP EN FINANZAS CUANTITATIVAS

Horario	1 de julio de 2004 (Jueves)	2 de julio de 2004 (Viernes)
9:45-11:30	Asimetrías en los mercados de acciones Helena Chuliá (Hipólit Torrè UV) Comentarista: Amado Peiró (UV)	Cuentas nocionales: Una aplicación al caso español M^a Carmen Boado (Carlos Vidal UV) Comentarista: Enrique Devesa (UV)
	Transmisión de volatilidad entre mercados financieros Pilar Soriano (Francisco Climent UV) Comentarista: Bartolomé Pascual-Fuster (UIB)	Riesgo en cédulas hipotecarias Raquel Bujalance (Eva Ferreira UPV) Comentarista: Román Ferrer (UV)
	Hedge Funds Mercedes Andrés (Miguel A. Martínez UPV) Comentarista: Juan Carlos Matallín (UJI)	Selección de activos en un contexto de VaR Álvaro Villar (Susan Orbe UPV) Comentarista: Pedro Gento (UCLM)
Pausa Café		
12:00-13:30	Gestión del riesgo en entornos no-gaussianos Unai Ansejo (Aitor Bergara UPV) Comentarista: Fernando Tusell (UPV)	Presente y Futuro de los Mercados de Valores David Cascan (Miguel A. Martínez UPV) Comentarista: Jorge Yzaguirre (SB)
	El mercado eléctrico español, un mercado con futuros Jorge de La Cruz (Julio Lucia UV) Comentarista: Pablo Villaplana (UPF)	Ponencia invitada Aurelio Martínez (Presidente del ICO y Catedrático de Economía Aplicada, UV)
Comida		
16:00-18:00	Solución numérica de la ec.de Black Scholes: un nuevo método Agueda Madoz (Lucas Jódar UPoIV) Comentarista: Manuel Moreno (UPF)	Subastas de Volatilidad Toni Vaello (Gonzalo Rubio UPV) Comentarista: José Manuel Ortiz-Repiso (SB)
	Jump diffusion processes with Shot Noise effects and their applications to Finance Pedro Serrano (Manuel Moreno UPF) Comentarista: David Nualart (UB)	Valoración de carteras de préstamos con cópulas de Arquímedes Santiago Comín (Eva Ferreira UPV) Comentarista: Alfonso Novales (UCM)
	Valoración de bonos corporativos con negociación poco frecuente Verónica Matalí (Antonio Díaz UCLM) Comentarista: Vicente Meneu (UV)	Estudio Multifractal de las series financieras Miguel Pastor (Antonio Turiel ICM-CSIC) Comentarista: Ignacio Olmeda (UAH)

Lugar de celebración: Sala Ignacio Villalonga, 1er. piso de la Facultad de Economía de la Universidad de Valencia
www.uv.es/qf