

# VI WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS

Universidad de Castilla La Mancha  
Universidad del País Vasco

Universitat de València  
Universidad Complutense de Madrid

Patrocinado por FUNCAS

JUEVES 12 DE JUNIO 2008

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
16:00	Francisco Javier Rincón	"Predicción de la estructura temporal en España: el papel de los indicadores macroeconómicos"	Pilar Abad Alfonso Novales	Gloria Soto U. Murcia
16:45	Gregorio Vargas Martínez	"Volatilidad estocástica multivariante mediante modelos Wishuart autoregresivos: Aplicaciones a valoración de activos y gestión de riesgos financieros"	Manuel Moreno	Antoni Vaello U. I. Balears
17:30	DESCANSO			
18:00	Rafael Vivó García	"Análisis del enfoque Least-Squares Monte Carlo en la valoración de contratos sobre almacenamiento de Gas Natural"	Manuel Moreno Pablo Villaplana	Alvaro Cartea University of London
18:45	José Alfredo Jiménez Moscoso	"Estimación de la correlación cambiante en el tiempo entre activos, mediante modelos de volatilidad: Implicaciones"	Alfonso Novales	Vicente Aragón Universitat Jaume I

VIERNES 13 DE JUNIO 2008

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:45	Antton Barandiarán Sarasola	"On the Risk Premia Embedded in CDO Tranches"	Manuel Moreno Pedro J. Serrano	J.Fernández Navas U. P. Olavide
10:30	Eneritz Muguruza Epelde	"Raíces unitarias y medias cambiantes"	Eva Ferreira Susan Orbe	Antonio Rubia U. Alicante
11:15	DESCANSO			
11:45	Aitziber Unzueta Intxaurre	"El valor de la información y el valor de la solución en modelos de optimización bajo incertidumbre"	Araceli Garín	J. F.Monge U. M. Hernández
12:30	CONFERENCIA	Modeling Electricity Prices with Forward Looking Capacity Constraints	Alvaro Cartea	Alvaro Cartea University of London
14:00	COMIDA			
16:00	Juan Ayora	"Momentum en los mercados de futuros financieros"	Hipòlit Torrò	Luis Muga U. P. Navarra
16:45	Germán Guerrero Chaparro	"Valores extremos y gestión del riesgo financiero"	Alfonso Novales	Alfredo Ibáñez Caja Madrid

Lugar de celebración: Sala Manuel Sánchez Ayuso Facultad de Economía, primer piso, Campus Naranjos, Universidad de Valencia
--