

## VIII WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS

Univ. de Castilla La Mancha  
Univ. del País Vasco

 **Master en Banca y Finanzas Cuantitativas**

Univ. de València  
Univ. Complutense de Madrid

Patrocinado por FUNCAS



JUEVES 1 DE JULIO 2010

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
16:00		<b>INAUGURACIÓN</b> Iñaki Goirizelaia, Rector de la UPV/EHU		
16:15	Naroa Marroquín	<i>Bounding Security Prices in Incomplete Markets. Does Stochastic Volatility Matter?</i>	Manuel Moreno (UCLM)	Silvia Mayoral (UC3M)
17:00	Martín Erauskin	<i>Near optimal control in multi armed restless bandit problem</i>	Eva Ferreira (UPV/EHU)	Urtzi Ayesta (BCAM)
17:45	<b>DESCANSO</b>			
18:15	Carme Frau	<i>Opciones Australianas sobre Activos de Renta Fija</i>	Manuel Moreno (UCLM)	Ricardo Correia (UC3M)
19:00	Hugo Herguedas	<i>Comparación de diferentes estimadores para beta cambiante: Un ejercicio de simulación</i>	Susan Orbe Ainhoa Zárraga (UPV/EHU)	Marta Regúlez (UPV/EHU)

VIERNES 2 DE JULIO 2010

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:30	Lexuri Fernández	<i>Improved stochastic simulation scheme for the pricing of barrier options</i>	Alberto Suárez (UAM)	Elena Akhmatkaya (BCAM)
10:15	Federico Platanía	<i>Analytical valuation of fixed-income derivatives under two new macro-financial term structure models</i>	Manuel Moreno (UCLM)	Pedro Serrano (UC3M)
11:00	<b>DESCANSO</b>			
11:30	Lucía Hernandis	<i>Contraste de la Hipótesis de Expectativas en el mercado interbancario europeo</i>	Hipolit Torró (UV)	Javier Gardeazabal (UPV/EHU)
12:15	Andrea Vitali	<i>Un enfoque no parametrico a la predicción de la volatilidad para la medición del riesgo de mercado</i>	Unai Ansejo (ITZARRI)	Juncal Cuñado (UNAV)
13:00	J. Mauricio Bedoya	<i>Una versión estocástica del modelo de Gordon (caso Bank of America y Citigroup)</i>	Angel León (UA)	Marina Balboa (UA)
14:00	<b>COMIDA</b>			
16:00	Gustavo Guardia	<i>Evidencia empírica sobre la incorporación de asimetría y curtosis en la valoración de opciones del Eurostoxx 50</i>	Gregorio Serna (UCLM)	Begoña Font (UV)
16:45	Gabriela Godoy	<i>Correlaciones dinámicas en la gestión de riesgos y la selección de carteras: Un estudio empírico entre países desarrollados y emergentes</i>	Alfonso Novales (UCM)	Helena Chuliá (UOC)
17:30	<b>DESCANSO</b>			
18:00	<b>CONFERENCIA INVITADA: "Perspectivas de la economía española"</b> M <sup>a</sup> Jesús Fernández (Gabinete de Coyuntura y Estadística, FUNCAS)			
19:00	<b>Presentación BBVA</b>			
21:30	<b>CENA Y ENTREGA DE PREMIOS FUNCAS, Gran Hotel Domine BILBAO</b>			

**Lugar de celebración:** Zubiría Etxea, Salón de Grados, Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales, Universidad del País Vasco Avda. Lehendakari Aguirre 83 Bilbao