

XI WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



Univ. De Castilla La Mancha
Univ. Del País Vasco

Univ. De Valencia
Univ. Complutense de Madrid

Patrocinado por
FUNCAS



JUEVES, 4 DE JULIO 2013

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	INAUGURACIÓN			
9:30	Borja Montealegre	Valoración de derivados de renta fija según el enfoque Kristensen-Mele	Manuel Moreno (UCLM) y Javier F. Navas (UPO)	Federico Platanía (UCM)
10:00	Pablo Bru	Políticas óptimas de gestión de activos mediante programación dinámica	Alfredo García (UCM) y Francisco Álvarez (UCM)	Emilio Cerdá (UCM)
10:30	Andrés Mora	Cuantificación de riesgo en presencia de eventos extremos	Gonzalo García-Donato (UCLM) y Antonio Díaz (UCLM)	TBA
11:00	DESCANSO			
11:30	Ángela Amat	Competencia y estabilidad financiera: la importancia de la crisis	Juan Fernández (UV) y Ximo Maudos (UV)	Luis Pedauga (UGR)
12:00	Francisco Menéndez	Modelización del efecto cíclico de la economía en el crédito agregado, la prima de riesgo y los tipos de interés. Un análisis comparativo para Alemania, Francia y España	Lola Robles (UCM)	Jesús Ruiz (UCM)
12:30	Carlos Catalán	Pricing equity derivatives with the Kristensen-Mele approach	Manuel Moreno (UCLM) y Javier F. Navas (UPO)	TBA
13:00	Francisco Navarro	Out-of-Sample Performance of Mean-Variance Strategies: Is Active Portfolio Management Worth the Effort in Europe?	Martin Lozano (UM)	David Moreno (UC3M)
14:00	COMIDA			
16:00	JORNADA EMPRESAS Y JOB MARKET: ETS, CRF, KPMG, BBVA			
18:00	DESCANSO			
18:30	Pau Felip	Correlación entre renta variable y fija en el contexto internacional	Alfonso Novales (UCM)	Rosa Rodríguez (UC3M)
19:00	Diana González	Comportamiento de los tipos de interés en los mercados emergentes durante la crisis financiera actual: El caso de México.	Antonio Díaz (UCLM)	Mariano González (CEU-Valencia)
19:30	Patricia Vázquez	Estimating the ex-ante tracking error: emphasis on the forecast of the variance and covariance matrix	Alfonso Novales (UCM) y Mónica Mastrobernardino (Credit Suisse AG)	Antonio Díaz (UCLM)

VIERNES, 5 DE JULIO 2013

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:30	Emilio Chafer	La rentabilidad de los índices socialmente responsables y medioambientales. Un estudio del caso europeo.	Pilar Soriano (UV)	Lola Robles (UCM)
10:00	Luis Arribas	Extending the Nowak-Romaniuk approach for pricing catastrophe bonds	Manuel Moreno (UCLM) y Javier F. Navas (UPO)	Antonio Díaz (UCLM)
10:30	Rocío Altelarra	Estimación del precio de mercado del riesgo en base a los futuros del crudo y sus derivados y análisis de su relación con las variables macroeconómicas	Gregorio Serna (UAH) y Javier Población (BdE)	Pablo Villaplana (CNE)
11:00	DESCANSO			
11:30	Aída Alemany	Volatility Transmission Among European Bank CDS	Ana González (UN) y Laura Ballester (UV)	Pedro Serrano (UC3M)
12:00	Pablo Urtubia	Las correlaciones de Latibex con índices de mercados desarrollados: implicaciones para diversificación y cobertura	Alfonso Novales (UCM)	Juan Angel Lafuente (UJI)
12:30	Montse Bustó	Análisis de los determinantes del tipos de interés de la deuda soberana dentro y fuera de una unión monetaria	Roberto Blanco (BdE), Ricardo Gimeno (BdE) y Alfonso Novales (UCM)	Eliseo Navarro (UAH)
13:00	CONFERENCIA INVITADA: J. Trujillo (INTERMONEY) Titulación y Crisis Financiera.			
14:00	COMIDA			
21:30	CENA Y ENTREGA DE PREMIOS			

**Lugar de celebración: Sede FUNCAS. C/ Caballero de Gracia, 28
28013 Madrid**