

# XII WORKSHOP EN BANCA Y FINANZAS CUANTITATIVAS



Patrocinado por FUNCAS



Univ. de Castilla La Mancha  
Univ. del País Vasco

Univ. de Valencia  
Univ. Complutense de Madrid

**JUEVES, 10 DE JULIO 2014**

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	<b>INAUGURACIÓN:</b> D. Joaquín Goyache, Vicerrector de Posgrado y Formación Continua (UCM)			
9:30	Gorka Koldo González	About the applications of Fourier transform methods to option pricing	Manuel Moreno (UCLM) y Federico Platanía (UCM)	Alvaro Montealegre (BS)
10:00	Iñaki Ramos	Cobertura de Credit Default Swaps de emisores españoles	Alfonso Novales (UCM) y Alvaro Chamizo (BBVA)	Pedro Serrano (UC3M)
10:30	David Romero	CDS vs rating: ¿Anticipan los CDS cambios de rating en la deuda corporativa española?	Lola Robles (UCM) y Pilar Abad (URJC)	Laura Ballester (UV)
11:00	<b>DESCANSO</b>			
11:30	Guzmán Hernández	A dynamic evaluation: Out-of-sample performance of investment strategies	Martín Lozano (MBS)	Elena Márquez (UCM)
12:00	Maite Cubas	Why do not Spanish investors like SRI funds?	Miguel A. Martínez (UPV/EHU)	Laura Albareda (DBS)
12:30	Luis David González	¿Qué explica el comportamiento tendencial en los precios de los commodities?	Alfonso Novales (UCM)	Raquel Balbás (UCM)
13:00	Lorena Moldes	Value-at-Risk versus Expected Shortfall: ¿Es relevante la propuesta de Basilea III?	Alfonso Novales (UCM) y Juan Angel Jiménez (UCM)	David Veredas (ULB)
13:30	<b>COMIDA</b>			
16:00	<b>CONFERENCIA INVITADA:</b> “El proceso de Comprehensive Assessment: Asset quality Review y Stress Test en Europa. Comprobando la fortaleza del sistema financiero europeo” Juan Carlos García Céspedes, Director de Metodologías de Riesgo de BBVA			

**VIERNES, 11 DE JULIO 2014**

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	Giovana Muñoz	Pueden ser utilizados los tipos forward para mejorar las predicciones de tipos de interés futuros?	Alfonso Novales (UCM)	Lucía Cuadro (BdE)
9:30	Aitor Fiz	Pairs trading: An empirical study	Alfonso Novales (UCM)	Eva Ferreira (UPV/EHU)
10:00	Aritz Armesto	What can metals offer to bond investors?	Alfonso Novales (UCM)	Oscar Carchano (UV)
10:30	<b>DESCANSO</b>			
11:00	Alberto Sánchez	Estimación de ratios de cobertura variantes en el tiempo de mínima varianza desde un enfoque 'Markov-Regime-Switching': Análisis con Petróleo, Oro y Trigo	Jesús Ruíz (UCM)	Juan Angel Jiménez (UCM)
11:30	Claudia Gregori	Efectos de la asimetría, curtosis y cópulas en las medidas de evaluación de carteras	Ángel León (UA) y Lluís Navarro (CEU)	Antonio Rubia (UA)
12:00	<b>DESCANSO</b>			
12:30	<b>JORNADA EMPRESAS: KPMG, BBVA y InterMoney Titulación</b>			
14:00	<b>COMIDA</b>			
21:30	<b>CENA Y ENTREGA DE PREMIOS</b>			

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