

XIII 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

LUNES, 6 DE JULIO 2015

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:30	INAUGURACIÓN			
9:45	Cristina Martos	Análisis sobre los escenarios de estrés test propuestos por la EBA	Javier Población (ECB)	Jesús Ruiz (UCM)
10:30	Catalina Gaebler	Latencia y calidad del mercado: El caso del SIBE Smart en el Mercado Español	Roberto Pascual (UIB)	Jorge Yzaguirre (BME)
11:15	Ana Barreda	Efecto sobre las cotizaciones de las empresas con el anuncio de su admisión en el Ibex35. Análisis empírico	Simón Sosvilla (UCM)	Mikel Tapia (UC3M)
12:00	DESCANSO			
12:30	Ausias Fuster	Análisis dinámico de carteras de mínima varianza y lower partial moments	Angel León (UA) Manuel Moreno (UCLM)	Juan Angel Jiménez (UCM)
13:15	Sebastián Gómez	Relación entre el mercado accionario y de CDS: Análisis bajo un enfoque no lineal	María Dolores Robles (UCM)	Oscar Carchano (UV)
14:00	COMIDA			
16:00	Alexander Zumba	Pricing Forward Contracts in Power Markets: A comparative study for the Spanish case	M. Dolores Furió (UV)	Gregorio Serna (UAH)
16:45	Eva María Vela	Estimación del spread de crédito de contrapartidas sin cotizaciones de credit default swap	Manuel Moreno (UCLM) Alberto Fernández (BS)	Álvaro Chamizo (BBVA)
17:30	Angie Rodríguez	La sincronía en el precio de las acciones y el riesgo de crédito: evidencia empírica de Estados Unidos	M. Dolores Robles (UCM) Pilar Abad (URJC)	Rubén García (BBVA)

MARTES, 7 DE JULIO 2015

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	Samuel Jiménez	Cálculo eficiente del CVA para carteras reales de renta fija	Alvaro Montealegre (BS) Manuel Moreno (UCLM)	Alberto Fernández (BS)
9:45	Fernando Villalba	Correlated default probability in CVA	Manuel Moreno (UCLM) Federico Platanía (U. Liège)	Alvaro Montealegre (BS)
10:30	Nidia López	Cobertura del riesgo de divisa en carteras internacionales	Alfonso Novales (UCM) Juan Angel Jiménez (UCM)	Pilar Abad (URJC)
11:15	Cristian Otero	Exposición a tipos de cambio: análisis del riesgo emergente como alternativa de diversificación	Alfonso Novales (UCM)	Elena Márquez (UCM)
12:00	DESCANSO			
12:30	CONFERENCIA INVITADA: "CRISIS, NUEVOS RIESGOS Y SU REGULACIÓN" Julio Segura, ex-presidente de CNMV			
14:00	COMIDA			
16:00	Elena Renedo	Volatility Spillovers among Alternative Energy, Oil and Technology Global Markets	Pilar Soriano (UV)	Vicente Medina (REPSOL)
16:45	Marta Salvador	Productos sobre cestas. Aproximación al riesgo de Modelo	Manuel Moreno (UCLM) Raquel Bujalance (BS)	Marcos de Castro (AFI)
17:30	Héctor Pérez	Interrelaciones entre crédito y renta variable en el marco sectorial europeo	Alfonso Novales (UCM)	Laura Ballester (UV)
18:15	Nerys Ramírez	Estado actual y efecto financiero del stock de reservas y los descubrimientos mundiales de petróleo	Javier Población (ECB)	Lucía Cuadro (BE)

MIÉRCOLES, 8 DE JULIO 2015

HORA	AUTOR/A	TÍTULO	DIRECTOR/A	COMENTARISTA
9:00	Patricia Luch	Estrategia Riding y la QE	Óscar Carchano (UV) Antonio Díaz (UCLM)	Unai Ansejo (Itzari)
9:45	Miren del Ama	The cross-border spillover effect of credit rating events on sovereign CDS: evidence on the emerging markets	Laura Ballester (UV) Ana González (UPNA)	Lidia Sanchís (UCLM)
10:30	Paula Cruz	Competencia <i>versus</i> estabilidad en los márgenes de intermediación bancarios. Comparación internacional	Juan Fernández de Guevara (UV)	Carlos Salvador (CUNEF)
11:15	David Castaño	Effects of the scenarios proposed by EBA stress tests on traded bank stocks	Javier Población (ECB) M ^o Dolores Furió (UV)	Miguel Artiach (UPV/EHU)
12:00	D E S C A N S O			
12:30	JORNADA EMPRESAS: KPMG, ETS, INDRA, INTERMONEY			
14:30	C O M I D A			
16:00	JORNADA EMPRESAS: ALTAIR, PRICE WATERHOUSE, REPSOL			
18:00	D E S C A N S O			
18:30	JORNADA EMPRESAS: SANTANDER, NFOQUE, BBVA			
21:30	CENA Y ENTREGA DE PREMIOS			

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