

FECHA DE PREINSCRIPCIÓN
Hasta el 27 de enero de 2016

LUGAR DE CELEBRACIÓN
Sala Ignacio Villalonga
1er pis, Facultat d'Economia
Universitat de València
Av. dels Tarongers s/n
e-mail: laura.ballester@uv.es
e-mail: oscar.carchano@uv.es
web: www.catedrafinanzas.es

ORGANIZA

Cátedra de Finanzas Internacionales Banco
Santander – Universitat de València

PATROCINA

Cátedra de Finanzas Internacionales Banco
Santander – Universitat de València
Facultat d'Economia (UEVG)



Research Workshop on Credit Default Swaps

Valencia, viernes 29 de enero de 2016
de 9:45h a 16:45h

[http:// www.catedrafinanzas.es](http://www.catedrafinanzas.es)

OBJETIVO

Presentación de *Papers* relacionados con los mercados de CDS, para su posterior discusión.

DESCRIPCIÓN DE LA ACTIVIDAD

En este *Workshop* se abordan las últimas líneas de investigación que se están desarrollando sobre los mercados de CDS nacionales e internacionales. El objetivo de esta Jornada es que sirva como foro de debate y de intercambio de ideas y experiencias entre los investigadores tanto del mundo profesional como del académico, además de poner al día a los posibles asistentes que estén interesados en estos mercados.

DESTINATARIOS

Destinado a los estudiantes del Máster en Ciencias Actuariales y Financieras, miembros de la UVEG, de la comunidad universitaria en general y los profesionales del sector.

COORDINADORES Y COMITÉ ACADÉMICO

Laura Ballester Miquel

Óscar Carchano Alcina

*Miembros del Comité Académico de la Cátedra de Finanzas Internacionales – Banco Santander
Dep. d'Economia Financera i Actuarial.
Universitat de València*

PROGRAMA PONENCIAS

09:45-10:00 Presentación

Sesión 1

10:00 -10:25

“Interrelaciones entre crédito y renta variable en el marco sectorial europeo”,
Héctor Pérez, Nfoque Advisory Services.
Alfonso Novales, Universidad Complutense de Madrid.

10:35-11:00

“The cross-border spillover effect of credit rating events on sovereign CDS: evidence on the emerging markets”,
Miren del Ama, Everis.
Laura Ballester, Universidad de Valencia.
Ana González-Urteaga, Universidad Pública de Navarra.

11:10-11:35

“Estimación del spread de crédito de contrapartidas sin cotizaciones de credit default swap”,
Eva María Vela, Indra Business Consulting.
Alberto Fernández, Banco Santander.
Manuel Moreno, Universidad de Castilla La Mancha.

11:45-12:15 Coffee Break

Sesión 2

12:15-12:40

“Cobertura de Credit Default Swaps de emisores españoles”,
Iñaki Ramos, Nfoque Advisory Services.
Alfonso Novales, Universidad Complutense de Madrid.
Álvaro Chamizo, BBVA

12:50-13.15

“Características de los CDS nacionales de la zona EURO”,
Vicente Medina, Repsol.
Sergio Sanz, Indra.
Óscar Carchano, Universidad de Valencia.

13:25-15:00 Pausa para comer

Sesión 3

15:00-15:25

“Revisando la dinámica entre los spread de CDS y los rendimientos de las acciones bajo un enfoque no lineal”,
María Dolores Robles, Universidad Complutense de Madrid.
Sebastián Gómez, Lumni Inc

15:35-16:00

“Market frictions and the pricing of sovereign credit default swaps”,
Lidia Sanchís, Universidad de Castilla La Mancha.
Antonio Rubia, Universidad de Alicante.
Pedro Serrano, Universidad Carlos III de Madrid.

16:10-16:35

“Determinants of the multiple-term structures from interbank rates”,
Pedro Serrano, Universidad Carlos III de Madrid.
Juan Ángel Lafuente, Universidad Jaume I.
Nuria Petit, Universidad Complutense de Madrid.

16:45 Clausura del Workshop