

## PONENCIAS V FORO DE FINANZAS

### DERIVADOS

#### 1.- FRANCISCO JAVIER CALERO GARCÍA

LA FUNCION DE «PRICE DISCOVERY» DE LOS MERCADOS DE FUTUROS: EL CASO ESPAÑOL

#### 2.- PEDRO LECHON FLETA, RAFAEL SANTAMARIA AQUILUE

EL MODELO DE VALORACION OGARCH. PRIMEROS RESULTADOS EN LA OPCION SOBRE EL IBEX 35

#### 3.- ANTONIO DE LA TORRE GALLEGOS, MANUEL ANGEL

MARTIN LOPEZ, ROCIO MILLAN NAVARRO

UNA APROXIMACION A LOS DERIVADOS OTC SOBRE PRODUCTOS ENERGETICO

#### 4.- JOSE GARCIA PEREZ, SALVADOR CRUZ RAMBAUD, ANTONIO

S. ANDÚJAR RODRÍGUEZ

LA METODOLOGIA PERT EN LA VALORACION DE OPCIONES

#### 5.- LUISA NIETO SORIA, ANGELES FERNANDEZ IZQUIERDO,

MARIA JESÚS MUÑOZ TORRES

PROPUESTA DE UN ANÁLISIS DE EFICIENCIA Y EVIDENCIA EMPÍRICA EN EL MERCADO DE FUTUROS SOBRE IBEX 35

#### 6.- PILAR CORREDOR, PEDRO LECHON, RAFAEL SANTAMARIA

EFFECTOS EN EL DIA DE VENCIMIENTO DE LOS MERCADOS DERIVADOS. ANALISIS DEL IBEX-35 DE CONTADO Y DEL FUTURO SOBRE EL IBEX-35

#### 7.- VICENTE ARAGO MANZANA, M. A. FERNANDEZ IZQUIERDO

ANALISIS DEL DINAMISMO DE LA RAZON DE COBERTURA DE MININA VARIANZA

#### 8.- JAVIER FERNANDEZ NAVAS

PRICING INTEREST-RATE DERIVATIVES WITH YIELD-CURVE TERM STRUCTURE

MODELS

ANÁLISIS DE LA RELACIÓN DE PARIDAD CALL-PUT EN OPCIONES

MERCADO BURSÁTIL Y FONDOS

9.- *JUAN JOSE GARCIA MACHADO, JUAN JOSE DE LA VEGA  
JIMÉNEZ*

LA VOLATILIDAD EN EL MERCADO BURSÁTIL ESPAÑOL

10.- *MANUELA BOSCH PRINCEP, HORTENSIA FONTANALS  
ALBIOL*

INVESTMENT PORTFOLIO OF A PENSION FUND BY MEANS OF AGREGATION  
SCENARIO

11.- *JUAN CARLOS MATALLIN SÁEZ, M- ANGELES FERNÁNDEZ  
IZQUIERDO*

ANÁLISIS DE LA CLASIFICACIÓN DE LOS FONDOS DE INVERSIÓN EN ESPAÑA:  
IMPLICACIONES EN LA MEDIDA DE SU PERFORMANCE

12.- *MARIA JOSE PALACIN SÁNCHEZ, CECILIA TÉLLEZ VALLE*

LA VALORACION DE LAS ADQUISICIONES POR EL MERCADO: LA OPA DE ENDESA  
SOBRE SEVILLANA Y FECSA

13.- *NATIVIDAD BLASCO DE LAS HERAS, RAFAEL SANTAMARIA  
AQUILUE*

REGIONES DE ALTA DENSIDAD DE PREDICCIÓN: UNA APLICACION SOBRE SERIES  
DE RENTABILIDAD DIARIAS EN EL MERCADO DE VALORES ESPAÑOL

14.- *ANGEL LEON VALLE, JOAQUIN MARHUENDA*

NUEVAS EVIDENCIAS SOBRE ESTACIONALIDAD DIARIA EN EL PRECIO DE LAS  
ACCIONES

15.- ANTONIO DIAZ PEREZ, ELISEO NAVARRO ARRIBAS

ESTUDIO DE LA DEPENDENCIA DEL DIFERENCIAL DE RENTABILIDAD Y EL PLAZO HASTA EL VENCIMIENTO EN LA DEUDA PRIVADA ESPAÑOLA

16.- FERNANDO PEREZ DE GRACIA HIDALGO, CARMEN ARANDA LEON

¿REACCIONA EL MERCADO BURSÁTIL ESPAÑOL ANTE LAS INTERVENCIONES DEL BANCO DE ESPAÑA?

17.- CRISTOBAL GONZÁLEZ BAIXAULI, M- PAZ JORDA DURA

LA CONVEXIDAD NEGATIVA EN LOS MBS

18.- LUIS FERRUZ AGUDO, M- PILAR PORTILLO TARRAGONA, JOSE LUIS SARTO MARZAL

ESTRUCTURA TEMPORAL DE TIPOS DE INTERÉS E INMUNIZACION CONTINGENTE

19.- MANUEL ILLUECA, JOAQUIN MAUDOS

RENDIMIENTOS BURSÁTILES Y EFICIENCIA PRODUCTIVA: EL CASO DE LA BANCA ESPAÑOLA

FINANZAS EMPRESARIALES

20.- RAMON NOVA GALLARDO

FINANCIACION DEL CREDITO DE LOS PROVEEDORES A LA ADMINISTRACION PÚBLICA: EL CONFIRMING

21.-VICENTE GARCIA MARTIN, MANUEL ANGEL FERNÁNDEZ GÁMEZ, MATILDE RIOS BENITEZ

LA CREACION DE VALOR: BREVE ANÁLISIS DE SU FUNDAMENTACION

*22.- JESÚS DUARTE MERELO*

APLICACION DE LAS REDES NEURONALES ARTIFICIALES  
EN LAS FINANZAS

*23.- ANA LOZANO VIVAS, TRINIDAD GOMEZ NUÑEZ, MARIA  
RUBIO MISAS*

FACTORES EXPLICATIVOS DE LAS DIFERENCIAS EN EFICIENCIAS DE LAS  
INSTITUCIONES BANCARIAS

*24.- ANXO R. CALVO SILVOSA, FÉLIX R. DOLDÁN TIÉ*

LOS MODELOS DE PLANIFICACIÓN FINANCIERA Y CORPORATIVA COMO  
SISTEMAS DE APOYO A LA DECISIÓN: UN ENFOQUE DE SISTEMAS DE  
INFORMACIÓN

*25.- M- ESTHER VAQUERO LAFUENTE*

APROXIMACIÓN A LA TEORÍA DE LA RESPONSABILIDAD SOCIAL  
DE LA EMPRESA SEGÚN FRIEDMAN

*26.- ANTONIO ALEGRE ESCOLANO*

PRIMA DE RIESGO DE INSOLVENCIA EN UNA CARTERA DE PRÉSTAMOS

*27.- SALVADOR CRUZ RAMBAUD, MARIA DEL CARMEN VALLS  
MARTINEZ*

LEYES FINANCIERAS ESCINDIBLES PARA UNA OPERACIÓN Y SEGUN UNA  
ACCION

*28.- IMPORTANCIA DE LA RELACION PRESTAMISTA-  
PRESTATARIO EN LA FINANCIACION DE LAS EMPRESAS DE  
MENOR TAMAÑO*

*29.- ANA ESTHER CASTRO, JOSE FRANCISCO TEIXEIRA*

EVOLUCIÓN Y DISTRIBUCIÓN DE LA RIQUEZA FINANCIERA DEL  
ENDEUDAMIENTO DE LAS ECONOMÍAS DOMÉSTICAS EN ESPAÑA

RIESGO

30.- JOSE LUIS MARTIN MARIN, MARIA DOLORES OLIVER  
ALFONSO, ANTONIO DE LA TORRE GALLEGOS

CALCULO DEL VALOR EN RIESGO POR EL METODO DE MONTECARLO  
ESTRUCTURADO

31.- FRANCISCO PÉREZ CALATAYUD, JAVIER GINER RUBIO  
APLICACIÓN DEL MÉTODO DE MONTE CARLO A LA VALORACIÓN DE ACTIVOS  
FINANCIEROS

32.- ROMAN FERRER LAPEÑA, JAVIER SANTOMA JUNCADELLA,  
ALTINA SEBASTIÁN GONZÁLEZ

ANÁLISIS SECTORIAL DEL RIESGO DE INTERES EN EL MERCADO ESPAÑOL DE  
RENTA VARIABLE

33.- MONICA PEDROSA RODRIGUEZ, TERESA CORZO  
SANTAMARÍA

VAR: ANÁLISIS DE LOS DIVERSOS MÉTODOS UTILIZADOS.....

34.- LUCY AMIGO DOBAÑO

DETERMINANTES DEL TIPO DE CAMBIO: UN MARCO TEORICO Y UNA  
APROXIMACION EMPIRICA

35.- ARACELI REIG PÉREZ, IRENE RAMÍREZ COMEIG

EFFECTO DE LA INFORMACIÓN ASIMÉTRICA SOBRE EL RIESGO Y EL  
COMPORTAMIENTO DE LAS SOCIEDADES DE GARANTÍA RECÍPROCA: UN  
ANÁLISIS EMPÍRICO

36.- MARIANO CEJAS RODRIGUEZ, SANDRA MORINI MARRERO

ESTIMACION DE PÉRDIDAS EN SWAPS DE TIPOS DE INTERES:  
UNA ALTERNATIVA AL VAR

**37.- PEDRO MARTQNEZ SOLANO, ANGEL BERGES LOBERA**

EFFECTOS DEL RIESGO DE CAMBIO EN EL VALOR DE LA EMPRESA Y SUS  
FACTORES EXPLICATIVOS

MESA DE ÉTICA

**38.- FERNANDO GOMEZ-BEZARES**

LOS PROBLEMAS ÉTICOS DE LA ESPECULACION

**39.- JAIME LORING**

REFLEXIONES ÉTICAS SOBRE EL SISTEMA FINANCIERO .....