

1^a jornada tecnològica

Finances Quantitatives

1^a edició

La Recerca Financera a l'Empresa

**Promoció i dinamització de
la cooperació entre els
àmbits acadèmic i
professional.**

**Auditori CRM
22 de febrer de 2013**

Conferències:

Javier Calvo (Management Solutions)

"Reptes quantitius en les proves de resistència (stress test)
d'entitats financeres."

Javier Norte (Deloitte)

"Calibració de PD en carteres low default: Alternatives
quantitatives al mapping."

Eduard Giménez (CaixaBank)

"Més enllà de Black-Scholes quan els mercats es tornen
incomplets."

Dr. Luis Ortiz Gracia (CRM)

"Mesura eficient del risc de concentració en carteres de crèdit
amb les onetes de Haar."

Sergio Baena (Banc Sabadell)

"Càlcul del VaR com a mesura del risc"

Ramon Trias (AIS)

"Integració de riscos: crèdit, mercat, liquiditat, a partir del
RDF."

Fernando Valles (PwC)

"Utilització de còpules en l'estimació del capital econòmic."

Amb la participació especial de:

Santiago Carrillo Menéndez (UAM)

"Bringing economic sense to economic capital in operational
risk: the use of right truncated models for severity
distribution."

Inscripcions:

www.crm.cat/2013/JornadaFinancera

