

<b>DÍA 1:</b>	<b>27 de Septiembre de 2018</b>		
<b>8:30 a 9:45</b>	<b>REGISTRO DE PARTICIPANTES</b>		
<b>9:45 a 10:30</b>	<b>INAUGURACIÓN Lugar: Auditorio Raúl J. Marsal</b>		
<b>10:30 a 10:35</b>	Preparación conferencia magistral		
<b>10:35a 11:45</b>	<b>Conferencia magistral: "Las dimensiones de la administración de riesgos"</b> <b>Mtro. Alfonso de Lara Haro. Autor del libro: Medición y control de riesgos</b> <b>Lugar: Auditorio Raúl J. Marsal</b>		
<b>11:45 a 12:00</b>	<b>RECESO</b>		
<b>Mesa</b>	<b>Sesión 1</b>	<b>Sesión 1</b>	<b>Sesión 1</b>
<b>Sala</b>	<b>Mesa de trabajo 1</b> Administración de riesgos e ingeniería financiera <b>Sala de Examen 1</b>	<b>Mesa de trabajo 2</b> Mercados e instituciones financieras <b>Sala de Examen 2</b>	<b>Mesa de trabajo 3</b> Optimización y modelos financieros <b>Sala de Juntas (1er. Piso)</b>
12:00 a 13:30	¿Es el ciclo combinado la tecnología de generación de electricidad de carga base más barata?	Medición y comparación de los beneficios de invertir en economías emergentes contra un portafolio global	Estimación de la volatilidad a partir de un modelo autorregresivo de rango condicional para series de criptoactivos
	<b>María del Carmen Gómez Ríos</b>	<b>Oscar V. De la Torre Torres</b>	<b>Eloisa Cadenas Morales</b>
	Universidad Anáhuac México Norte	Universidad Michoacana de San Nicolás de Hidalgo	Facultad de Ingeniería, Universidad Nacional Autónoma de México
	Metodologías SCRUM y opciones reales para la gestión y valuación de proyectos tecnológicos	Preferencias del Banco de México, entre inflación y desempleo, para el periodo 2005-2018	Pronósticos de la TIIE mediante modelos AR(1) con parámetros invariantes vs variantes en el tiempo
	<b>Mónica Andrea Arauco Ballesteros; Elio Agustín Martínez Miranda</b>	<b>Leovardo Mata Mata Gabriela Heredia Lobato</b>	<b>Julio César Soriano Villarreal Francisco López-Herrera</b>
	Facultad de Ingeniería, Universidad Nacional Autónoma de México	Universidad Anáhuac; Tecnológico de Monterrey	Facultad de Contaduría y Administración, Universidad Nacional Autónoma de México
	Nonparametric Approach to Measure Risk: The Case of Electricity Markets	The Effect of Inflation Target Regimes in Commodities-Based, Financialized Economies on Income Growth and Distribution in Latin America	Dynamic Stock Dependence and Monetary Variables in the United States (2000-2016): A Copula and Neural Network Approach
	<b>Lilian González Marulanda Javier Pantoja Robayo</b>	<b>Santiago Capraro</b>	<b>Magnolia Miriam Sosa Castro Christian Bucio Pacheco Edgar Ortiz</b>
Universidad EAFIT, Colombia.	Facultad de Economía Universidad Nacional Autónoma de México	Universidad Autónoma Metropolitana-Iztapalapa; Unidad Huehuetoca, Universidad Autónoma del Estado de México; F. de Ciencias Políticas y Sociales, Universidad Nacional Autónoma de México	
<b>13:30 a 13:45</b>	<b>RECESO</b>		

13:45 a 14:30	<b>Presentación de proyectos editoriales Lugar: Auditorio Raúl J. Marsal</b>		
14:30 a 14:45	<b>Traslado a la Torre de Ingeniería</b>		
14:45 a 16:15	<b>COMIDA Lugar: Torre de Ingeniería</b>		
16:15 a 16:30	<b>Traslado al Edificio "T"</b>		
<b>Mesa</b>	<b>Sesión 2 Mesa de trabajo 4</b>	<b>Sesión 2 Mesa de trabajo 5</b>	<b>Sesión 2 Mesa de trabajo 6</b>
	<b>Mercados e instituciones financieras</b>	<b>Administración de riesgos e ingeniería financiera</b>	<b>Optimización y modelos financieros</b>
<b>Sala</b>	<b>Sala de Examen 1</b>	<b>Sala de Examen 2</b>	<b>Sala de Juntas (1er. Piso)</b>
<b>16:30 a 18:00</b>	Valuación de opciones financieras: extensión del modelo B&S incluyendo costos de transacción	Patrón de dependencia en el índice de morosidad del crédito al consumo en México: Un enfoque de teoría de cópulas dinámicas, 2000-2017	Optimización Robusta de Portafolios
	<b>José Roberto Torres Bello Magnolia Miriam Sosa Castro</b>	<b>David Conaly Martínez Vázquez, Christian Bucio Pacheco</b>	<b>María de los Ángeles Pérez Rojo Patricia Saavedra Barrera</b>
	Facultad de Ingeniería, Universidad Nacional Autónoma de México; Universidad Autónoma Metropolitana - Iztapalapa	Unidad de Estudios Profesionales Huehuetoca, Universidad Autónoma del Estado de México	Universidad Autónoma Metropolitana - Iztapalapa
	Relación entre los precios internacionales del petróleo y la mezcla mexicana en el periodo 2010-2018	Mapeo de riesgo de los índices bursátiles mexicano, español y estadounidense	Empleo de modelos markovianos de cambio de régimen en la administración activa de portafolios socialmente responsables
	<b>Leovardo Mata Mata Kevin Estupiñan Mancilla Martha Beatriz Mota Aragón</b>	<b>José A. Climent Hernández; Domingo Rodríguez Benavides Arturo Aguilar Vázquez</b>	<b>Oscar V. De la Torre Torres</b>
	Universidad Anáhuac y Tecnológico de Monterrey; Universidad Autónoma Metropolitana-Iztapalapa	Universidad Autónoma Metropolitana Azcapotzalco	Universidad Michoacana de San Nicolás de Hidalgo
	Volatilidad del precio de las modalidades del petróleo crudo mexicano en el periodo de enero de 1999 a junio de 2017	Competitividad bilateral de México y China: un análisis de los mercados financiero y bursátil	Efectos de la volatilidad del índice VIX sobre los mercados latinoamericanos
	<b>Fernando Cruz-Aranda, José Carlos Ramírez Agustín I. Cabrera Llanos</b>	<b>Francisco Javier Reyes Zárate</b>	<b>Alejandro Fonseca-Ramírez Roberto J. Santillán-Salgado Francisco López-Herrera</b>
Universidad Panamericana, Campus Cd. de México; Unidad Profesional Interdisciplinaria de Biotecnología, Instituto Politécnico Nacional	Universidad Autónoma Metropolitana, Azcapotzalco	EGADE Business School, Tecnológico de Monterrey; Facultad de Contaduría y Administración, Universidad Nacional Autónoma de México	
18:00 a 18:15	<b>RECESO</b>		
18:15 a 19:15	<b>Conferencia especial: "Las dimensiones de la administración de riesgos" Alberto Hernández Barragán. QuantaShares. Lugar: Auditorio Raúl J. Marsal</b>		

<b>DÍA 2:</b>	<b>28 de Septiembre de 2018</b>	
<b>8:00 a 9:00</b>	<b>REGISTRO DE PARTICIPANTES</b>	
<b>Mesa</b>	<b>Sesión 3 Mesa de trabajo 7 Economía financiera</b>	<b>Sesión 3 Mesa de trabajo 8 Optimación financiera y modelos financieros</b>
<b>Sala</b>	<b>Sala de Examen 1</b>	<b>Sala de Juntas (1er. Piso)</b>
<b>9:00 a 10:30</b>	Barreras de acceso en la inversión de las familias mexicanas: decisiones bajo el enfoque de regresión cuantílica	Autómata para el mercado accionario usando Martingalas
	<b>Giselle Arely Jáuregui Rojas Francisco Javier Reyes Zárate</b>	<b>Jaime Alberto Gómez Vilchis Federico Hernández Álvarez Luis I. Román de la Sancha</b>
	Facultad de Ingeniería, Universidad Nacional Autónoma de México; Universidad Autónoma Metropolitana-Azcapotzalco	Facultad de Ciencias, Universidad Nacional Autónoma de México
	Determinantes del sobreendeudamiento de los hogares en México	Algorithmic Trading Strategies for Capital Markets: A Low Frequency Algorithm Proposal
	<b>Héctor Eduardo Díaz Rodríguez</b>	<b>Ana Lorena Jiménez Preciado</b>
	Facultad de Economía, Universidad Nacional Autónoma de México	Escuela Superior de Economía, Instituto Politécnico Nacional
	Factores de riesgo sistemático en México y deterioro de la cartera de hipotecas bursatilizadas	Formulación de un modelo híbrido alfa -estable para mercados con operación de alta frecuencia
	<b>Margarita M. Mosso Martínez Francisco López-Herrera</b>	<b>Luis Fernando Hoyos-Reyes José A. Climent Hernández Marissa R. Martínez Preece</b>
Universidad Anáhuac; Facultad de Contaduría y Administración, Universidad Nacional Autónoma de México	Universidad Autónoma Metropolitana-Azcapotzalco	
<b>10:30 a 10:45</b>	<b>RECESO</b>	

Mesa Sala	Sesión 4 Mesa de trabajo 9 Mercados e instituciones financieras Sala de Examen 1	Sesión 4 Mesa de trabajo 10 Economía financiera Sala de Examen 2	Sesión 4 Mesa de trabajo 11 Optimización y Modelos financieros Sala de Juntas (1er. Piso)
10:45 a 12:15	Capitalising Against Tail Risk. Has Basel IV Gone Too Far?	Las correlaciones dinámicas de contagio financiero: Estados Unidos y América Latina	The Real Estate Investment Trusts Industry and the Financial Crisis: Modeling Volatility
	<b>Adrian F. Rossignolo</b>	<b>Domingo Rodríguez Benavides Ignacio Perrotini Hernández</b>	<b>Roberto J. Santillan-Salgado Humberto Valencia-Herrera</b>
	University of Leicester, Reino Unido	Universidad Autónoma Metropolitana-Azcapotzalco; Facultad de Economía, Universidad Nacional Autónoma de México	EGADE Business School, Tecnológico de Monterrey
	Financial Stress and the Probability of Sovereign Default	Co-movimientos entre los índices accionarios y los ciclos económicos de Estados Unidos y México	La inversión en portafolios de activos mexicanos y estadounidenses socialmente responsables
	<b>Caterina Rho Manrique Saenz</b>	<b>Luis Ignacio Román de la Sancha Federico Hernández Álvarez Gabriel Rodríguez García</b>	<b>Luis Guadalupe Macías-Trejo Francisco López-Herrera Oscar V. de la Torre Torres</b>
	Banco de México; International Monetary Fund	Facultad de Ingeniería, Universidad Nacional Autónoma de México	Universidad Michoacana de San Nicolás de Hidalgo; Facultad de Contaduría y Administración, Universidad Nacional Autónoma de México
	Análisis de riesgo en los rendimientos de las Siefres básicas mexicanas	Dependencia condicional en el bloque TLCAN: un análisis con modelos GARCH y Cópula	Distribuciones de probabilidad de los rendimientos accionarios en la BMV en el periodo 2010-2018
	<b>Francisco Javier Reyes Zárate Marissa R. Martínez Preece Carlos Zubieta Badillo</b>	<b>Magnolia Miriam Sosa Castro Christian Bucio Pacheco Alejandra Cabello Rosales</b>	<b>Leovardo Mata Mata Martha Beatriz Mota Aragón Diego Burillo Parres</b>
	Universidad Autónoma Metropolitana-Azcapotzalco	Universidad Autónoma Metropolitana-Iztapalapa; Unidad Huehuetoca, Universidad Autónoma del Estado de México; Facultad de Química, Universidad Nacional Autónoma de México	Egade Business School, Tecnológico de Monterrey; Universidad Autónoma Metropolitana - Unidad Iztapalapa
12:15 a 12:30	<b>RECESO</b>		
12:30 a 12:45	<b>Traslado a la Torre de Ingeniería</b>		
12:45 a 13:55	<b>Conferencia magistral: "Valor en Riesgo (VaR) y el dogma de la diversificación" Dr. Arturo Erdely. Programa de Actuaría. UNAM – FES Acatlán. Lugar: Torre de Ingeniería</b>		
13:55 a 14:00	<b>Preparación clausura</b>		
14:00 a 14:45	<b>Clausura</b>		
14:45 a 17:00	<b>Brindis de despedida</b>		