

## CONGRESO



DOS JÓVENES INVESTIGADORAS, PREMIADAS EN EL 3º CONGRESO INTERNACIONAL DE FINANZAS COMPUTACIONALES

## Congreso Internacional de Finanzas Computacionales

El 3º Congreso Internacional de Finanzas Computacionales (ICCF2019) se clausuró este viernes en A Coruña, con la entrega del premio del Journal of Computational Finance al mejor trabajo presentado por jóvenes investigadores durante el congreso.

© REDACCIÓN ECONOMÍA EN GALICIA 12 JUL. 2019

Universidad de A Coruña finanzas computacionales Beatriz Salvador Mancho riesgo de contrapartida Congreso Internacional de Finanzas Computacionales



El catedrático de Matemática Aplicada Carlos Vázquez, las investigadoras Beatriz Salvador Mancho y Anastasia Borovykh, y Christoph Reisinger: editor del Journal of Computational Finance.

El premio que entrega la Revista de Finanzas Computacionales recayó finalmente en dos investigadoras. Por un lado, se reconoció el trabajo de la palentina **Beatriz Salvador Mancho**, que hizo su tesis doctoral en la Universidad de A Coruña con los profesores de Matemática Aplicada Carlos Vázquez Cendón e Íñigo Arregui, coordinadores del congreso.

**Beatriz ha estudiado matemáticamente y resuelto numéricamente nuevos modelos de riesgo de contrapartida.** "El riesgo de contrapartida surge cuando en un contrato alguna de las partes puede incumplir las condiciones del mismo. Por ejemplo, si se compra un piso a una constructora sobre plano, si hay posibilidad de que quiebre y que no te lo entregue, entonces esto debería intervenir en el precio de compra, pues no es lo mismo que si le compramos el mismo piso a una promotora, que nos lo entregará con seguridad", explica Beatriz. Esa diferencia es el valor del riesgo de contrapartida, que se ha incorporado desde la última crisis financiera de 2007, cuando se negocian productos financieros derivados. En su trabajo se proponen nuevos modelos y se resuelven para valorar el riesgo de contrapartida.

Por otro lado, se galardonó a la investigadora holandesa **Anastasia Borovykh. En finanzas en ocasiones se usan las series temporales para predecir las cotizaciones futuras.** Cuando estas series incorporan ruido y se usan redes neuronales, es importante alcanzar un equilibrio entre la complejidad de la función de aprendizaje y su capacidad para ajustar los datos de mercado, especialmente para su uso generalizado. Esto requiere el empleo de herramientas matemáticas rigurosas, que es lo que ha hecho Anastasia en su trabajo, desarrollado en colaboración con el profesor y matemático holandés Kees Oosterlee, que también ha intervenido en este congreso. La joven investigadora ha realizado su tesis en el marco de un doctorado industrial europeo en el que ha participado la Universidad de A Coruña.

### Presencia de más de un centenar de expertos

A lo largo de los cinco días del 3º Congreso Internacional de Finanzas Computacionales, más de 120 expertos académicos y profesionales del ámbito de las finanzas cuantitativas y sus aspectos computacionales presentaron los **avances más recientes en temas relacionados con el sector financiero y asegurador.** Este congreso ha estado organizado por la Universidad de A Coruña, con la colaboración de la Fundación Barrié, CITIC, Instituto Tecnológico de Matemática Industrial, European Consortium of Mathematics and Industry, Abanca, Afundación y Risk.net.