

GANADORES PREMIO MERCADOS FINANCIEROS 2009

Premio Mercados Financieros \$200,000 *

Nombre del autor: **Carlos Alberto Reyes Martínez**

Por su trabajo titulado: *“Correlaciones Dinámicas en la Evaluación del Riesgo de Crédito: Un Modelo de Dos Factores”*

Institución: Colegio de México



Foto: Carlos Alberto Reyes



Presidium: Jorge Alegría, Dr. Luis Téllez, Dr. Guillermo Ortiz, Pedro Zorrilla, Jaime Díaz



Guillermo Ortiz Martínez - Gobernador del Banco de México



Segundo Lugar \$50,000

Nombre del autor: Alfonso Mendoza Velázquez
y María del Pilar Gómez Gil

Por su trabajo titulado: "*Herramientas para el pronóstico de la Calificación Crediticia de las Finanzas Públicas Estatales en México: Redes Neuronales Artificiales, Modelo PROBIT Ordenado y Análisis Discriminante*"

Institución: Universidad Popular Autónoma del Estado de Puebla, Instituto Nacional de Astrofísica, Óptica y Electrónica.

Mención Especial

Nombre del autor: Andrew Dermot Tennyson

Por su trabajo titulado: "*El efecto día festivo en la Bolsa Mexicana de Valores*"

Institución: Universidad Anáhuac

TESIS

Primer Lugar \$75,000

Nombre del autor: Norma Isabel Quezada
Sánchez

Por su trabajo titulado: "*Organismos Autorregulatorios del Mercado de Valores*"

Institución: Universidad Nacional Autónoma de México

Segundo Lugar \$35,000

Nombre del autor: Jesús Hermilo Zurita Acosta

Por su trabajo titulado: "*Medición del Riesgo de Mercado bajo condiciones propicias para la distorsión de los precios*"

Institución: Instituto Tecnológico Autónomo de México

Mención Especial

Nombre del autor: Fabián Martínez Montoya

Por su trabajo titulado: "*Propuesta de una nota estructurada fiduciaria conjunta como una alternativa de financiamiento a través del Mercado de Valores para las instituciones micro-financieras en México*"

Institución: Instituto Tecnológico Autónomo de México



PREMIO NACIONAL DE DERIVADOS

INVESTIGACIÓN

Primer Lugar \$125,000

Nombre del autor: Francisco García Castillo

Por su trabajo titulado: "*Valuación del seguro de depósitos de México: un enfoque moderno*"

Institución: Instituto Tecnológico y de Estudios Superiores de Monterrey

Segundo Lugar \$50,000

Nombre del autor: Adán Díaz Hernandez

Por su trabajo titulado: "*Modelo de valuación de opciones bajo múltiples cambios de régimen y asimetría de la volatilidad: proceso Garch-M de coeficientes flexibles a opciones sobre futuros del IPC*"

Institución: Universidad de Essex, Reino Unido

TESIS



Primer Lugar \$75,000

Nombre del autor: Gabriel López-Moctezuma
Jassán y Andrea San Martín Kuri Breña

Por su trabajo titulado: "*Ineficiencias en el mercado cambiario en México: ¿Prima de riesgo o irracionalidad?*"

Institución: Instituto Tecnológico Autónomo de México

Segundo Lugar \$35,000

Nombre del autor: Denisse López Jiménez

Por su trabajo titulado: "*Parámetros de Riesgo para Cámaras de Compensación y Liquidación en el Mercado de Derivados*"

Institución: Universidad Nacional Autónoma de México

Mención Especial

Nombre del autor: Gerardo Cevallos Orvañanos

Por su trabajo titulado: "*El impacto de las operaciones del mercado de derivados en la volatilidad del mercado spot: el caso de la tasa de interés de corto plazo en México*"

Institución: Centro de Investigación y Docencia Económicas









