

GRUPO BOLSA MEXICANA DE VALORES

Tiene el agrado de informar los nombres de los ganadores del Premio Mercados Financieros, Premio Nacional Bolsa Mexicana de Valores y Premio Nacional de Derivados 2012.

Ganadores del Premio Mercados Financieros

Acreedor a una Recompensa Económica de: \$100,000.00*

Autor: Juan Pablo Solórzano Margain

Trabajo Titulado: "Pruebas de estrés macroeconómicas y contagio en el sistema financiero mexicano"

Institución: BANXICO



**La recompensa económica total a la que se hacen acreedores los ganadores del Premio Mercados Financieros y ganadores del Primer Lugar en la Categoría de Tesis tanto del Premio Nacional BMV como del Premio Nacional de Derivados es de \$100,000.00 (Cien mil pesos 00/100 M. N.) cada uno.*

Ganadores del Premio Nacional Bolsa Mexicana de Valores

Categoría de Tesis

Primer Lugar

Acreeador a una Recompensa Económica de: \$50,000.00

Autor: Juan Pablo Solórzano Margain

Trabajo Titulado: *"Pruebas de estrés macroeconómicas y contagio en el sistema financiero mexicano"*

Institución: UNAM



Segundo Lugar

Acreedor a una Recompensa Económica de: \$25,000.00

Autor: Juan José Sánchez Azcarate

Trabajo Titulado: "Una estrategia de arbitraje estadístico"

Institución: ITAM



Menciones Especiales:

Sin Recompensa Económica

Autor: Gerardo Cevallos Orvañanos

Trabajo Titulado: "A Market Anomaly in the Mexican Stock Returns"

Institución: London School of Economics



Sin Recompensa Económica

Autores: Maria Fernanda Alvarado Rojero, Lorena González de León y Jesús Alberto Enriquez de la Vega

Trabajo Titulado: "Reformulación del Portafolio de las Siefores utilizando en Modelo Black-Litterman y la lógica Borrosa"

Institución: UDEM



Categoría de Investigación:

Primer y segundo lugar:

El jurado calificador dictaminó declarará **desiertos** los premios del primero y segundo lugar después de haber evaluado todos los trabajos que se presentaron a concursar en esta categoría.

Mención Especial

Sin Recompensa Económica

Autor: Arturo Cortés Aguilar

Trabajo Titulado: "Estimación del residual de un bono respaldado por hipotecas mediante un modelo de riesgo de crédito: una comparación de resultados de la teoría de cópulas y el modelo IRB de Basilea II en datos del mercado hipotecario mexicano."

Institución: ITESM CCM



Ganadores del Premio Nacional de Derivados

Categoría de Tesis:

Primer lugar

Acreedor a una Recompensa Económica de: \$50,000.00

Autor: Juan Carlos Álvarez Campero

Trabajo Titulado: *"Uso de Cópulas, series, aproximaciones numéricas y regresión logística en la valuación de obligaciones de Deuda con Colateral (CDOS): Propuesta de extensión para adaptar la metodología de Glasserman & Suchintabandit al caso México"*

Institución: ITAM



Segundo lugar

Acreeador a una Recompensa Económica de: \$25,000.00

Autor: Alfredo Nieves Cisneros

Trabajo Titulado: "La autorregulación del mercado de derivados en México"

Institución: UNAM



Categoría de Investigación:

El jurado calificador dictaminó declarará desiertos los premios del primero y segundo lugar después de haber evaluado todos los trabajos que se presentaron a concursar en esta categoría.

**LAS EMPRESAS DEL GRUPO BMV FELICITAN A LOS
GANADORES DE LA EDICIÓN 2012 DEL PREMIO
MERCADOS FINANCIEROS**

