

III. BREVE RESUMEN DE LA DOCENCIA IMPARTIDA POR EL DEPARTAMENTO

El Departamento ha impartido docencia en las siguientes titulaciones:

- Licenciatura en Administración y Dirección de Empresas
- Licenciatura en Economía
- Licenciatura en Administración y Dirección de Empresas y Derecho
- Licenciatura en Economía y Derecho
- Ingeniería Industrial
- Ingeniería de Telecomunicación
- Licenciatura en Documentación
- Licenciatura en Ciencias y Técnicas Estadísticas
- Diplomatura en Ciencias Empresariales
- Diplomatura en Gestión y Administración Pública
- Diplomatura en Informática de Gestión
- Diplomatura en Relaciones Laborales
- Diplomatura en Estadística
- Ingeniería Técnica Mecánica
- Ingeniería Técnica Electrónica
- Ingeniería Técnica Electricidad
- Ingeniería Técnica de Informática de Gestión

Además el departamento colabora en la impartición de los siguientes doctorados:

- Doctorado en Economía
- Doctorado en Ingeniería Matemática

Por último el Departamento imparte docencia en los siguientes Master y Títulos propios de la Universidad:

- Master en Calidad Total en los Servicios.
- Master de Economía Industrial
- Master de Finanzas
- Master en Administración de Empresas

III. COURSES OFFERED BY THE DEPARTMENT

The Department offers courses included in the curriculum for the following degrees:

- Licenciatura en Administración y Dirección de Empresas
- Licenciatura en Economía
- Licenciatura en Administración y Dirección de Empresas y Derecho
- Licenciatura en Economía y Derecho
- Ingeniería Industrial
- Ingeniería de Telecomunicación
- Licenciatura en Documentación
- Licenciatura en Ciencias y Técnicas Estadísticas
- Diplomatura en Ciencias Empresariales
- Diplomatura en Gestión y Administración Pública
- Diplomatura en Informática de Gestión
- Diplomatura en Relaciones Laborales
- Diplomatura en Estadística
- Ingeniería Técnica Mecánica
- Ingeniería Técnica Electrónica
- Ingeniería Técnica Electricidad
- Ingeniería Técnica de Informática de Gestión

The Department is also involved in the following Ph.D. programs:

- Doctorado en Economía
- Doctorado en Ingeniería Matemática

Finally, the Department is also involved in the programs leading to the following Master degrees:

- Master en Calidad Total en los Servicios
- Master de Economía Industrial
- Master de Finanzas
- Master en Administración de Empresas

IV. PROYECTOS DE INVESTIGACION

IV. RESEARCH GRANTS AND PROJECTS

1999-2000

Alonso-Borrego, C. Participante en el Proyecto de Investigación Europeo financiado por la Unión Europea "CHER" ("Consortium of household panels for european socio-economic research") dirigido por S. Jiménez. Año de comienzo: 2000. Año fin: 2002. El objetivo de este proyecto es generar una base de datos longitudinal de hogares europeos que haga posible la comparabilidad entre hogares de distintos países mediante la armonización de las variables contenidas en cada base de datos nacional. Las fuentes de datos a partir de las cuales se generará esta base de datos son el Panel Europeo de Hogares y un gran número de paneles nacionales independientes.

Alonso-Borrego, C. He participates in the "CHER" Project of the European Union ("Consortium of household panels for european socio-economic research") under the direction of S. Jiménez. Beginning: 2000. End: 2002. The goal of this project is to generate a longitudinal database of european homes that makes feasible comparisons among different country homes. To this aim, variables of different countries will be harmonized. The source to build this database will be the European Home Panel and a variety of independent national panels.

Alonso-Borrego, C. Participante del Proyecto de Investigación Europeo "Labor market effects of foreign direct investments". Año inicio: 2000. Año fin: 2002. Este proyecto pretende examinar empíricamente los efectos de la inversión extranjera directa sobre el mercado de trabajo en cinco países europeos: España, Irlanda, Italia, Reino Unido y Suecia. Mientras ciertos creen que la inversión extranjera crea puestos de trabajo, otros ven con preocupación el impacto de esta inversión sobre el empleo. Para resolver este debate, este proyecto adoptará un enfoque empírico, utilizando un panel de datos (a nivel de empresas).

Alonso-Borrego, C. He participates in the european research project "Labor market effects of foreign direct investments". Beginning: 2000. End: 2002. This project aims to empirically study the effects of direct foreign investment on the labour market of five european countries: Spain, Ireland, Italy, England and Sweden. To this aim, an empirical approach will be adopted, using a harmonized international data panel. This data panel will be created in the context of this project. In addition, distribution of foreign direct investment and its impact on european countries will be studied. Finally, implications for economic policy will be also studied.

Aparicio, F.M. Participante en el Proyecto Nacional "Liquidez, microestructura y gestión de riesgos en mercados financieros" financiado por la DGICYT. Año inicio: 1999. Año fin: 2001. Se han desarrollado modelos econométricos dinámicos para series económicas cuya relación es no lineal y no estacionaria.

Aparicio, F.M. He participates in the DGICYT "Liquidity, microstructure and risk management in financial markets". Beginning: 1999. End: 2001. This project studies dynamic econometric models for nonlinear and nonstationary economic series.

Delgado, M.A. "Contrastes de especificación de modelos econométricos". Participantes: Velasco, C., Wolf, M., Sperlich, S. Fiteni, I., Miles, D. Proyecto de Investigación Nacional. Año inicio: 1999. Año fin: 2001. Financiado por la DGES. Proponemos una nueva metodología de contrastes de especificación para modelos paramétricos, no paramétricos y semiparamétricos. Esta metodología será aplicada para contrastar restricciones sobre curvas no paramétricas, como restricciones de aditividad y monotonicidad del modelo de

regresión no paramétrico y restricciones sobre

Delgado, M.A. Principal research of the project "Specification tests of econometric models". Beginning: 1999. End: 2001. This project propose a new methodology of specification contrasts for parametric, non parametric and semiparametric models. This methodology will be used to contrast constraints on non-parametric curves, such as additivity constraints and monotonicity of the non-parametric regression model, and constraints on general location functionals. Specification tests for long memory time series are also studied. Next, a heterocedasticity contrast for parametric models

funcionales de localización generales. También proponemos contrastes de especificación de modelos semiparamétricos, como modelos de series temporales de memoria larga, donde la estructura del corto plazo no es parametrizada y modelos microeconómicos tipo Tobit, donde la regresión de la variable latente es desconocida pero la distribución condicional de los errores está parametrizada. Por último proponemos un contraste de heterocedasticidad, consistente en la dirección de alternativas generales, para modelos paramétricos con un cambio estructural de localización desconocida y un método de estimación de la localización del cambio en modelos definidos mediante condiciones generales de momentos.

También proponemos diferentes proyectos de carácter empírico, como la estimación de una curva de costes de ajuste para el empleo no paramétrica, inferencia sobre índices de desigualdad para España utilizando el bootstrap y estimación de modelos microeconómicos no lineales con variables medidas con error.

Espasa, A. Director del "Boletín Inflación y Análisis Macroeconómico". Participantes: Albacete, R., Ezquer, F., Carrasco, N., Gaya, P., Jiménez-Martín, S., Peracchi, F., Garre, A., Sáiz, L. y Muñoz, I. Año de inicio: 1994. Con esta publicación mensual se pretende dar predicciones sobre el año corriente y siguiente de la inflación europea y en EE.UU. La publicación pone especial énfasis en realizar un diagnóstico sobre las perspectivas inflacionistas futuras y sus implicaciones de política monetaria y económica en general. Trimestralmente publica un estudio sobre el mercado de trabajo en España, Italia y Reino Unido basado en datos de panel sobre las encuestas de población activa de dichos países.

Espasa, A. Investigador principal del Proyecto de la Fundación Universidad Carlos III de Madrid: "Cátedra especial de investigación sobre Predicción y análisis macroeconómico". Fecha de inicio: 1995. El objetivo de esta cátedra es promover la investigación teórica y la aplicación a la economía española dentro del contexto europeo de las técnicas de predicción con especial orientación al análisis macroeconómico con fines de diagnóstico.

Espasa, A. Investigador principal del Proyecto financiado por la DGE "Modelización del paro, producto interior bruto e inflación en el área del euro y automatización del proceso periódico de predicción de dichas variables con fines de diagnóstico". Participantes: Albacete, R. Kaiser, R., Montes, J.L, Núñez, O. y Senra, E. Fecha

with a structural change of unknown location is proposed. Finally, a method of change location estimation is proposed for models defined by general moment conditions.

Regarding to empirical research, we propose the estimation of a non-parametric cost curve fit to employment, and inference on non-equality in Spain using bootstrap and estimation of microeconomic non-linear models with error-measured variables.

Espasa, A. Director of the "CPI Bulletin for Macroeconomic Analysis." Participants: M. Boldrin, C. Escribano, J. Urrutia, E. Senra, F. Lorenzo, Albacete, R. Starting: 1996. This monthly publication provides predictions over a period of two years for the Spanish inflation rate, through a disaggregated analysis based on different classes of goods and services. The publication emphasizes the diagnostics on future inflation perspectives and their implications on monetary and general economic policies.

Starting October 1996, this project has been sponsored by Price Waterhouse.

Espasa, A. Principal Investigator for the project of the Fundación Universidad Carlos III de Madrid: "Endowed Research Chair for Forecasting and Macroeconomic Analysis." Starting: 1995. The goal of this chair is to promote theoretical research and the application of forecasting techniques to the Spanish economy within a European framework, with special consideration to diagnostic tools from macroeconomic analysis.

de inicio: 1999. Año fin: 2002. Con la constitución de la Unión Monetaria europea, la implementación

Espasa, A. Principal research of DGES "Unemployment modelling, gross national product and inflation in euro area, and automation of the prediction of these variables to the aim of diagnostics". Beginning: 1999. de la política monetaria requiere disponer de predicciones fiables sobre variables agregadas

para el conjunto del área del euro como el paro, el producto interior bruto y la inflación. De hecho el BCE realiza una encuesta trimestral en que solicita predicciones de estas tres variables para el total de área a diferentes instituciones europeas, entre las que se encuentra este equipo investigador. En este proyecto la predicción de dichas variables se aborda con la construcción para cada una de estas variables de modelos específicos para cada país, llegándose a las predicciones del área agregando las correspondientes predicciones nacionales. Para el paro y el producto interior bruto se propone construir modelos autorregresivos de regímenes cambiantes con indicadores adelantados. Se investigará la construcción de modelos individuales por país y modelos con aunamiento (pooling) de datos por países. Resultados de un proyecto anterior de investigación dirigido por este investigador principal indican que en los precios que componen el índice de precios al consumo existe más de un factor común no estacionario, con lo que no existe una tendencia homogénea en los precios. En tal situación el análisis de la inflación de cada país debe realizarse desagregando el IPC. En el presente proyecto se adoptará esta orientación y se contemplará también el aunamiento de datos por países. Finalmente mediante sistemas expertos de inteligencia artificial se pretende automatizar el proceso de predicción con estos modelos y sobre todo el diagnóstico que pueda derivarse de las predicciones.

Espasa, A. Investigador principal del proyecto PB95-0299 de la D. G. de Enseñanza Superior, "Análisis Macroeconómico y diagnóstico para la política económica a partir del estudio y modelización de indicadores y magnitudes trimestrales". Participantes: E. Ruiz, R. Kaiser, E. Senra, J.M. Martínez, J.M. Revuelta, Albacete, R. Fecha de inicio: 1996. Duración: tres años. El proyecto pretende: (1) construir modelos univariantes y econométricos de los principales indicadores de la economía española utilizando cuando sea necesario estructuras no lineales, así como un modelo económico trimestral global de pequeñas dimensiones que recoja las relaciones no lineales existentes entre las variables; (2) determinar un procedimiento de enganche que permita compatibilizar las predicciones de los modelos mensuales con los de los trimestrales, y (3) para el desarrollo de lo anterior se

End: 2002. The knowledge of reliable predictions on unemployment, gross national product and inflation is necessary for the implementation of monetary policy in European Union.

This project develops specific country models for each of these variables. Area predictions are built by aggregating national predictions. Augmented autoregressive models are proposed to model unemployment and gross national product. Both specific country models and pooled data models will be investigated. Inflation on each country will be studied disaggregating IPC into four components: energy, non-elaborated food, rest of goods and services. The prediction and diagnostic processes will be automated by using expert systems.

realizará una investigación teórica sobre estructuras tendenciales no lineales y esquemas de cointegración apropiados a tales casos.

Espasa, A. Principal investigator of the DGES project PB95-0299, "Macroeconomic analysis and diagnostics for economic policy from the modelling and study of three-month indicators and magnitudes". Participants: E. Ruiz, R. Kaiser, E. Senra, J.M. Martínez, J.M. Revuelta, Albacete, R. Starting: 1996. Duration: three years. The project aims at: (1) building univariate econometric models for the most relevant indicators for the spanish economy, using nonlinear structures wherever necessary, as well as a low dimension, global quarterly economic model to capture the nonlinear relationships between the variables; (2) determining a linkage mechanism to ensure the compatibility of the predictions from the monthly and quarterly models; and (3) conducting the research required by the preceding aims in the fields of nonlinear trend structures, and cointegration schemes useful for the cases of interest.

Espasa, A. "Análisis de la evolución de los precios de la vivienda en España". Proyecto de Investigación Nacional. Año inicio: 1998. Año fin: 1999.

Espasa, A. "Características del modelo de desarrollo español en los últimos 20 años y problemas y potencialidades de la economía española hacia el futuro. Acción Especial. Año inicio: 1998. Año fin: 1999.

Espasa, A. Investigador principal en el proyecto "Inflación y competitividad en la Comunidad Autónoma de Madrid". Año inicio: 2000. Año fin: 2002.

Gonzalo, J. Investigador principal del proyecto "Modelos Econométricos con múltiples equilibrios: Análisis de la Estructura Temporal de los Tipos de Interés y de la Hipótesis de Mercados Eficientes", financiado por la Fundación Caja de Madrid. Duración: 1996-98. Se proponen nuevos modelos de relaciones de largo plazo, donde los equilibrios pueden ser múltiples y los ajustes hacia ellos pueden ser diferentes. Se desarrolla la teoría de la inferencia y estimación de estos modelos. Las aplicaciones van orientadas a tipos de interés y precios de activos financieros.

Gonzalo, J. participa en el proyecto de la DGICYT "Nolinealidades y Persistencia en Modelos Econometricos" cuyo investigador principal es Ignacio Peña. Año inicio: 1996, Año fin: 1999. En este proyecto se propone desarrollar una teoría unificadora para analizar relaciones económicas no-lineales a largo plazo entre variables con persistencia.

Gonzalo, J. participa en el proyecto de la Comunidad Económica Europea "New Approaches to the study of economic fluctuations" cuyo coordinador es Juan José Dolado. Año Inicio: 1998, Año fin: 2002. Este proyecto analiza cuestiones relacionadas con los ciclos económicos y el crecimiento.

Gonzalo, J. Participante en el proyecto "Persistencia, asimetría y volatilidad estocástica en el análisis de series temporales" dirigido por J.J. Dolado y financiado por la DGICYT. Participantes: Mármol, F.L., Ruiz, E. Año inicio: 1999. Año fin: 2001. Estudio de modelos econométricos que capten al menos dos de las

Espasa, A. "Análisis de la evolución de los precios de la vivienda en España". National Research Project. Beginning: 1998. End: 1999.

Espasa, A. "Características del modelo de desarrollo español en los últimos 20 años y problemas y potencialidades de la economía española hacia el futuro. Special Action. Beginning: 1998. End: 1999.

Espasa, A. Principal investigator of the project "Inflación y competitividad en la Comunidad Autónoma de Madrid". Beginning: 2000. End: 2002.

Gonzalo, J. Principal researcher for the project, "Econometric Models with Multiple Equilibrium: Analysis of the Term Structure of the Interest Rates and the Efficient Market Hypothesis," funded by the Caja de Madrid Foundation. 2 year project. New models are proposed for long-term relationships, where multiple equilibria may exist and the adjustments leading to them may be different. The inference and estimation theory for these models is developed. Applications are mostly oriented towards interest rates and the prices of other financial instruments.

Gonzalo, J. participates in the DGICYT "Nonlinearities and persistence in Econometric models". Principal researcher: Peña, I. This project develops a unified theory for the analysis of long-run nonlinear economic relationships among persistent economic variables.

Gonzalo, J. participates in the project of the European Union "New Approaches to the study of Economic Fluctuations". The coordinator is Juan José Dolado. Starts in 1998 and ends in the year 2002. This project analyses questions related to economic cycles and growth.

propiedades o características más comunes de las series económicas: persistencia o larga

Gonzalo, J. He participates in the DGICYT "Persistency, asymmetry and stochastic volatility in the analysis of time series". Principal research: J.J. Dolado. Beginning: 1999. End: 2001. This project studies econometric models to capture at least two common features of economic series: long memory, asymmetry and volatility.

memoria, asimetría o no linealidades y volatilidad.

Lillo, R. Participante en el proyecto de investigación nacional dirigido por la Universidad Politécnica y Complotense de Madrid "Diseño y formalización de leyes de aprendizaje en controladores adaptativos neuronales para sistemas dinámicos de elevada complejidad. Aplicación a robótica". Dirigido por Pedro José Zufiria Zaratán. Año inicio: 1998. Año fin: 2001. Aplicación de los procesos estocásticos en general y puntuales, en particular, a la modelización en robótica.

Peña, D. Investigador principal del proyecto del B.B.V: "Cátedra de Métodos para la Mejora de la Calidad". Participantes: Romo, J., Velilla, S., Villagarcía, T. Gil, J.A., Rodríguez, J., Poncela, P., Rivera, P. Yohai, V. Año de inicio: 1995. Año fin: 2000. El proyecto consiste en desarrollar nuevos métodos para el control y la mejora de la calidad en el sector servicios.

Peña, D. Investigador principal del Proyecto Nacional de la DGICYT "Construcción de modelos dinámicos multivariantes". Participantes: Muñoz, A., Prieto, F.J., Romo, J.J., Romera, R., Velilla, S., Villagarcía, T. y Yohai, V. Año de inicio: 1997. Duración: 3 años.

Prieto, F.J. "Estudio de sistemas de producción de energía eléctrica mediante técnicas de computación en paralelo". Proyecto de Investigación Nacional subvencionado por IBERDROLA. Año de inicio: 1997. Este proyecto se inscribe dentro del proyecto ESPRIT 22695, y tiene como objetivo el desarrollo de herramientas para la planificación de la producción de empresas eléctricas en el medio y corto plazo empleando herramientas de cálculo paralelo para permitir la consideración de situaciones de mercado competitivo dentro de la planificación.

Romera, R. Participante en el proyecto del Consejo Nacional de Ciencia y Tecnología (CONACYT) de México) "Optimización y Control Estocástico" bajo la dirección de Onésimo Hernández-Lerma. Inicio: 2000. Fin: 2002.

Romo, J. Investigador del proyecto "Community Innovation Survey II" de la Unión Europea. Año de inicio: 1999.

Lillo, R. She participates in the DGICYT project "Design and formalization of learning rules in neural adaptive controllers for high complex dynamical systems. Applications to robotics". Principal reseach: P.J. Zufiria Zaratán. Beginning: 1998. End: 2001. This project analyses the application of stochastic processes to robotic modellization.

Peña, D. Principal investigator for the BBV project: "Chair on Methods for Quality Improvement". Participants: Romo, J., Velilla, S., Villagarcía, T. Gil, J.A., Rodríguez, J., Poncela, P., Rivera, P. Yohai, Beginning: 1995. End: 2000. The project aims at developing new procedures for quality control and improvement in the service sector.

Peña, D. Principal investigator for the DGICYT project "Construcción de modelos dinámicos multivariantes". Participants: Muñoz, A., Prieto, F.J., Romo, J.J., Romera, R., Velilla, S., Villagarcía, T. y Yohai, V. Beginning: 1997. Duration: 3 years.

Prieto, F.J. "Study of electric energy generation systems using parallel computation techniques". Research Project funded by IBERDROLA. Beginning: 1997. This project lies within the scope of ESPRIT project 22695, and aims to developing tools to plan the short and medium term generation of electric companies using parallel computation techniques to be able to incorporate competitive market situations within the planning process.

Romera, R. She participates in the project "Optimization and Stochastic Control" of Consejo Nacional de Ciencia y Tecnología (CONACYT), México, under the direction of Onésimo Hernández-Lerma. Beginning: 2000. End: 2002.

Romo, J. Investigator for the project "Community Innovation Survey II" of the European Union. Beginning: 1999.

Wiper, M. Participante en el proyecto de investigación europeo “Robust bayesian analysis of stochastic processes” bajo la dirección de F. Ruggeri. Año de inicio: 1997. Año fin: 1999. Para hacer inferencia bayesiana para modelos de procesos estocásticos (colas).

Wiper, M. participates in the european reseach project “Robust bayesian analysis of stochastic processes” under the direction of F. Ruggeri. Beginning: 1997. Duration: 2 years. To study the use of bayesian inference on stochastic processes models (queueing models).

**V. TESIS DOCTORALES DIRIGIDAS
POR MIEMBROS DEL
DEPARTAMENTO**

V.

PH.D.

THESES

1999

Vidal, J.M. "*Consistencia universal de los estimadores delta: un enfoque basado en la teoría de la aproximación*". Director: Delgado, M.A. Universidad Carlos III de Madrid.

Alvarez, B. "*Especificación y validación de modelos de demanda de asistencia sanitaria, absentismo laboral y actitudes de los desempleados: aplicación al caso español*". Directores: Delgado, M.A. y Lobo, F. Universidad Carlos III de Madrid.

Fiteni, I. "*Inferencia en modelos econométricos con cambio estructural*". Directores: Delgado, M.A. e Hidalgo, J. Universidad Carlos III de Madrid.

González, M. "*Non-linear long run relationships: the threshold case*". Director: Gonzalo, J. Boston University.

Hernández, N. "*Los efectos internacionales de la política agraria común en el sector de la carne del vacuno*". Directores: Ruiz, E. y Pañeda, C. Universidad de Oviedo.

2000

Martínez Moguerza, J. "*Métodos de punto interior para optimización no convexa*". Director: Prieto, Fco. J. Universidad Carlos III de Madrid.

Martínez Martínez, J.M. "*Modelos univariantes para el análisis de ciclos económicos en España y USA. Modelos econométricos para funciones de demanda desagregada de las importaciones españolas con un estudio de la no-linealidad cíclica*". Director: Espasa, A. Universidad Carlos III de Madrid.

Mayoral, L. "*Técnicas de estimación y contraste para procesos fraccionalmente integrados*". Director: Gonzalo, J. Universidad Carlos III de Madrid.

Moreno, M. "*Remuestreo en series temporales*". Director: Romo, J.J. Universidad Carlos III de Madrid.

Nogales Martín, Fco. J. "*Resolución distribuida de problemas de optimización no lineal de gran tamaño*". Director: Conejo, A. y Prieto, Fco. J. Universidad Carlos III de Madrid.

VI. PUBLICACIONES Y DOCUMENTOS DE TRABAJO

VI. PUBLICATIONS AND WORKING PAPERS

Publicaciones

Publications

1999

Alonso-Borrego, C. "Progreso tecnológico y empleo: evidencia internacional", *Papeles de Economía Española*, Vol. 81, pp. 127-142.

Alonso-Borrego, C., Arellano, M. "Symmetrically normalized instrumental-variable estimation using panel data", *Journal of Business and Economics Statistics*, Vol. 17, pp. 36-49.

Aparicio, F.M. y Escribano, A. "Information Theoretic Analysis of Serial Correlation and Cointegration", *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*, Vol. 2

Delgado, M.A., Jaumandreu, J. y Martín-Marcos, A. "Input Costs, Utilization and Substitution in the short run", *Spanish Economic Review*, Vol. 1, pp. 239-262.

Kaiser, R. y Maravall, A. "Estimation of the business cycle: a modified Hodrick-Prescott filter", *Spanish Economic Review*, Vol. 1, pp. 175-206.

Kaiser, R. "Detection and estimation of structural changes and outliers in unobserved components", *Journal of Computational Statistics*, Vol. 14, pp. 533-558.

Lillo, R.E. y Martín, M. "Bayesian approach to estimation of ordered uniform scale parameters", *Journal of Statistical Planning and Inference*, vol. 87, pp. 105-118.

Lillo, R.E. y Neuts, M.F. "Two service units with interference in the access to servers", *Journal of Applied Mathematics and Stochastic Analysis* vol. 12, pp. 357-370.

Mármol, F.L. y Reboredo, J.C. "Near observational equivalence and fractionally integrated processes", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, Vol. 61, pp. 283-290.

Peña, D., Gómez, V. y Maravall, A. "Missing observations in ARIMA models: skipping strategy versus additive outlier approach", *The Journal of Econometrics*, Vol. 88, pp. 341-363.

Peña, D y Yohai, V. "A fast procedure for outlier diagnostics in large regression problems", *The Journal of the American Statistical Association*, Vol. 94, pp. 434-445.

Peña, D. "Entrevista con Daniel Peña", *Organización y Gestión Educativa*, Vol. 6, pp. 36-40.

Peña, D. y Justel, A. "Heterogeneity and model uncertainty in bayesian regression models", *Revista de la Real Academia de Ciencias*, Vol. 93, pp. 357-366.

Peña, D. y Prieto, F.J. "Comments on robust principal component analysis for functional data", *TEST*, Vol. 8, pp. 56-60.

Prieto, F.J., Escudero, L.F., de la Fuente, J.L. y García, C. "A parallel computation approach for solving multistage stochastic network problems", *Annals of Operations Research*, Vol. 90, pp. 131-160.

Romo, J.J. y Delicado, P. "Goodness-of-fit tests for random coefficient regressions", *Annals Inst. Math. Statist.*, Vol. 51, nº 1, pp. 125-148.

Sperlich, S. y Severance-Lossin, Eric "Estimation of derivatives for additive separable models", *Statistics*, Vol. 33, pp. 241-265.

Sperlich, S., Linton, O.B, y Härdle, W. "Integration and backfitting methods in additive models –finite sample properties and comparison", *Test*, vol. 8, pp. 419-458.

Velasco, C. "Gaussian semiparametric estimation of non-stationary time series", *Journal of Time Series Analysis*, Vol. 20, pp. 87-127.

Velasco, C. "Non-stationary log-periodogram regression", *The Journal of Econometrics*, Vol. 91, pp. 325-371.

Wiper, M.P. y Donnison, J.R. "Bayesian statistical analysis of asteroid rotation rates", *Monthly Notices of the Royal Astronomical Society*, Vol. 302, pp. 75-80.

Wolf, M., Politis, D.N. y Romano, J.P. "Weak convergence of dependent empirical measures with application to subsampling in function spaces", *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol. 79, pp. 179-191.

Wolf, M.; Romano, J.P. "Inference for the mean in the heavy-tailed case", *Metrika*, Vol. 50, pp. 55-69.

2000

Arranz, M.A. y Escribano, A. "Cointegration Testing under Structural Breaks: A Robust Extended Error Correction Model", *Oxford Bulletin of Economic and Statistics*, Vol. 62, pp. 23-52.

Delgado, M.A. e Hidalgo, J. "Nonparametric inference on structural breaks", *Journal of Econometrics*, vol. 96, pp. 113-144.

Delgado, M.A. y Mora, J. "A nonparametric test for serial independence of regression errors", *Biometrika* vol. 87, pp. 228-234.

Gonzalo, J. y Lee, Tae "On the robustness of cointegration tests when series are fractionally integrated", *Journal of Applied Statistics*, Vol. 27, pp. 821-827.

Lillo, R.E. "Note on relations between criteria for aging" *Reliability Engineering & System Safety*, vol. 67, pp. 123-129.

Lillo, R.E. y Martín, M. "Characterization and Computation of optimal policies for an M/G/1 priority queue" *The Belgian Journal of Operations Research, Statistics and Computer Science*, vol. 38, pp. 45-57.

Lillo, R.E. "Stability and irreducibility of queueing systems with finite capacity" *Queueing Systems*, vol. 35, pp. 129-139.

Lillo, R.E. y Martín, M. "Optimal operating policies for an M/G/1 exhaustive server-vacation model", *Methodology and Computing in Applied Probability*, vol. 2, pp. 153-167.

Lillo, R.E. "On the controllability of M/G/1 systems with the cycle criterion" *Systems & Control Letters*, vol. 41, pp. 29-39.

- Lillo, R.E. y Martín, M. "On optimal exhaustive policies for the M/G/1 queue" *Operations Research Letters*, vol. 27, pp. 39-46.
- Lillo, R.E. y Martín, M. "Bayesian approach to estimation of ordered uniform scale parameters", *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol. 87, pp. 105-118.
- Peña, D. y Prieto, Fco. J. "The kurtosis coefficient and the linear discriminant function", *Statistics and Probability Letters* 49, pp. 257-261.
- Peña, D., Gil, J.A. y Rodríguez, J. "Statistical research in Europe: 1985-1997", *TEST*, Vol. 9, pp. 255-281.
- Peña, D. y Guerrero, V.M. "Linear combination of information in time series with linear restrictions", *Journal of Forecasting*, Vol. 19, pp. 103-122.
- Romo, J.J. y Moreno, M. "Bootstrap tests for unit roots based on LAD estimation", *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol. 83, pp. 347-367.
- Velasco, C. "Non-gaussian log-periodogram regression", *Econometric Theory* 16, pp. 44-79.
- Velasco, C. "Local cross validation for spectrum bandwidth choice", *Journal of Time Series Analysis* 21, pp. 329-361.
- Velasco, C. y Lobato, I.N. "Long memory in stock-market trading volume", *Journal of Business and Economic Statistics*, Vol. 18, pp. 410-427.
- Wiper, M.P., Pettit, L.I. y Young, KDS. "Bayesian inference for a Lanchester type combat model", *Naval Research Logistics*, Vol. 47, pp. 542-558.
- Wolf, M. "Stock returns and dividend yields revisited: a new way to look at an old problem", *Journal of Business and Economic Statistics*, Vol. 18, pp. 18-30.
- Wolf, M. y Romano, J.P. "A more general central limit theorem for m-dependent random variables with unbounded m", *Statistics and Probability Letters*, Vol. 47, pp. 115-124.

Libros y colaboraciones

Books

1999

Wolf, M.; Politis, D.N.; Romano, J.P. Subsampling, Springer, EE.UU.

2000

Kaiser, R. y Maravall, A. Measuring business cycles in economic time series. *Lectures Notes in Statistics 154*, Springer Verlag, EE.UU. Monografía.

Peña, D., Tiao, G.C., Bisgaard, S., Hill, W. y Stigler, S. Box on Quality and Discovery, Wiley, EE.UU.

Colaboraciones en obras colectivas

Contributions to joint works

1999

Escribano, A. y Aparicio, F.M. "Cointegration: linearity, nonlinearity, outliers and structural breaks", en The Current State of Economic Science, Spellbound Publications, India, pp. 383-408.

Gonzalo, J. y Pitarakis, J.Y. "Dimensionality effect in cointegration analysis". A. Festschrift in honour of Clive W.J. Granger, en Cointegration, Causality and Forecasting, Oxford, Reino Unido, pp. 212-229.

Nogales, F.J., Conejo, A. J. y Prieto, F.J. "Un nuevo método de descomposición aplicado al reparto óptimo de cargas multiárea" en Proceedings de las VI Jornadas Luso-Espanholas de Engenharia Electrotécnica, vol. 2, Portugal, pp. 387-394.

Nogales, F.J., Prieto, F.J. y Conejo, A. "The multiarea AC optimal power flow problem: a new decomposition approach" en Proceedings of the 13th Power Systems Computation Conference, Noruega, pp. 1201-1206.

Peña, D. "Comment on Bayesian inference on latent structure in time series"; en Bayesian Statistics 6, Bernardo et al. (eds) Oxford Univ. Press, pp. 19-21.

Peña, D. "Comment on Quality indexes models"; en Bayesian Statistics 6, Bernardo et al. (eds) Oxford Univ. Press, pp. 456.

Prieto, F.J., Conejo, A., Alguacil, N. y Nogales, F.J. "Comment to a fast distributed implementation of optimal power flow" en IEEE Transactions on Power Systems, vol. 14-3, pp. 864.

2000

Lillo, R.E., Nanda, A., y Shaked, M. "Some Shifted stochastic orders" en *Recent Advances in Reliability Theory: Methodology, practice and inference*, Birkhauser ed. pp. 85-103.

Lillo, R.E., Belzunce, F., Ruiz, J.M. y Shaked, M. "Stochastic comparisons of nonhomogeneous processes" en Libro de abstracts del *Second International Conference on Mathematical Methods in Reliability*, Universidad Victor Segalen.

Peña, D.; López-Terradas, C. "La mejora de la calidad mediante la simplificación de procesos" en *Las Mejores Prácticas I, Club Gestión de Calidad*, pp. 169-182.

Peña, D., Alvarez, M.J. y Montes, M.J. "Total Quality Management: A Literature Review and Future Research Directions for the XXI Century" en *Production and Operations management: Facing the New Millenium*, POMS, pp. 279-290.

Sperlich, S. y Härdle, W. "Finance" en *Xplore-Learning Guide*, W. Härdle, S. Klinke y M. Müller (eds), pp. 285-306.

Sperlich, S. y Zelinka, J. "Generalized additive models" en *Xplore-Learning Guide*, W. Härdle, Z. Hlavka y S. Klinke (eds), pp. 171-220.

Sperlich, S., Golubev, Y., Härdle, W., Hlavka, Z., Klinke, S., y Neumann, M. "Wavelets" en *Xplore-Learning Guide*, W. Härdle, S. Klinke y M. Müller (eds), pp. 375-408.

Wiper, M.P. y Wilson, S. "Prior robustness in some common types of software reliability model" en *Robust Bayesian Statistics*, Springer Verlag, EE.UU., pp. 385-398.

Working Papers

Documentos de Trabajo

1999

Alonso-Borrego, C. y Aguirregabiria, V. "*Labour Contracts and Flexibility: Evidence from a Labor Market Reform in Spain*". WP 99-27 (07). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M. "*La enseñanza de estadística en Ingeniería de Telecomunicaciones*". D.T. 99-15 (01). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Delgado, M.A. y Vidal, J.M. "*On Universal Unbiasedness of Delta Estimators*". WP 99-37 (10). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Delgado, M.A. e Hidalgo, J. "*Bootstrap goodness-of-fit tests for FARIMA models*". WP 99-38 (11). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Delgado, M.A. y Vidal, J.M. "*Global rates of convergence for the bias of singular integral estimators and their shifted versions*". WP 99-45 (13). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Delgado, M.A., Fariñas, J.C. y Ruano, S. "*Firm's productivity and the export market: a nonparametric approach*". WP 99-54 (19). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Delgado, M.A. y Fiteni, I. "*Bootstrap test for parameter instability*". WP 99-69 (24). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gil, J.A., Peña, D. y Rodríguez, J. "*Trends in statistical research productivity by journal publications over the period 1985-1997*". WP 99-73 (26). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gil, J.A., Peña, D. y Rodríguez, J. "*Statistical research in Europe: 1985-1997*". WP 99-74 (27). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mayoral, L. "*A Fractional Dickey-Fuller Test*". WP 99-29 (08). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mármol, F. "*A Primer on Cointegration*". WP 99-58 (20). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "*Stochastic Threshold Unit Root Models*". WP 99-48 (14). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J. y Lee, T.H. "*Permanent and Transitory Components of GDP and Stock Prices: Further Analysis*". WP 99-50 (16). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Hernández, S. y Yohai, V.J. "*Locally and globally robust estimators in regression*". WP 99-60 (21). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Kaiser, R. y Maravall, A. "*Short-Term and Long-Term Trends, Seasonal Adjustment, and the Business Cycle*". WP 99-10 (02). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

- Kaiser, R. y Maravall, A. "Seasonal Outliers in Time Series". WP 99-49 (15). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Kaiser, R. y Maravall, A. "Estimation of the business cycle: a modified Hodrick-Prescott filter", 99-12, Banco de España-Servicio de Estudios, 1999.
- Mármol, F.L. y Krämer, W. "Ols-Based Asymptotic Inference in Linear Regression Models With Trending Regressors and $Ar(p)$ -Disturbances". WP 99-23 (05). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Mármol, F.L. y Krämer, W. "The Power of Residual-Based Tests for Cointegration When Residuals Are Fractionally Integrated". WP 99-24 (06). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Mármol, F.L. y Dolado, J.J. "Asymptotic inference for nonstationary fractionally integrated processes". WP 99-68 (23). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Mármol, F.L., Escribano, A. y Aparicio, F.M. "A New Instrumental Variable Approach for Estimation and Testing in Cointegrating Regressions". WP 99-12 (03). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Mármol, F.L. "How Spurious Features Arise in Case of Cointegration". WP 99-65 (22). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Mayoral, L. "A new minimum distance estimation procedure for ARFIMA processes". WP 99-89 (37). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Pascual, L., Romo, J. y Ruiz, E. "Effects of Parameter Estimation on Prediction Densities: A Bootstrap Approach". WP 99-31 (09). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Prieto, F.J., Conejo, A.J., y Nogales, F.J. "A New Decomposition Method Applied to Optimization Problems Arising in Power Systems: Local and Global Behaviour". WP 99-42 (12). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Prieto, F.J. y Peña, D. "The kurtosis coefficient and the linear discriminant function", WP 99-75 (28). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Romera, R. y Hernández-Lerma, O. "Limiting discounted-cost control of partially observable stochastic systems". WP 99-87 (35). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Romera, R. "Distributional aspects in partial least squares regression". WP 99-19 (04). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Ruiz, E. y Pérez, A. "Finite sample properties of a QML estimator of stochastic volatility models with long memory". WP 99-77 (29). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Sperlich, S., Grasshoff, U., y Schwalbach, J. "Executive pay and corporate financial performance: an explorative data analysis". WP 99-84 (33). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.
- Sperlich, S. y Profit, S. "Non-Uniformity of Job-Matching in a Transition Economy A Nonparametric Analysis for the Czech republic". WP 99-03 (01). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Sperlich, S., Rodríguez-Poo, J.M, y Fernández, A.I. “*Semiparametric three step estimation methods in labor supply models*”. WP 99-83 (32). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Sperlich, S., Tjostheim, D. y Yang, L. “*Nonparametric estimation and testing of interaction in additive models*”. WP 99-85 (34). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Velilla, S. “*Variable deletion, confidence regions and bootstrapping in linear regression*”. WP 99-72 (25). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Wolf, M., Politis, D.N., y Romano, J.P. “*On the Asymptotic Theory of Subsampling*”. WP 99-52 (17). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Wolf, M., Politis, D.N. y Romano, J.P. “*Subsampling, symmetrization, and robust interpolation*”. WP 99-53 (18). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Wolf, M. y Roman, J.P. “*Subsampling intervals in autoregressive models with linear time trend*”. WP 99-88 (36). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

2000

Alonso, A.M., Peña, D. y Romo, J. “*Forecasting Time Series with Sieve Bootstrap*”. WP 00-07 (01). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Alonso, A.M., Peña, D. y Romo, J. “*Resampling Time Series by Missing Values Techniques*”. WP 00-42 (19). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García, A. “*Synchronicity Between Macroeconomic Time Series: An Exploratory Analysis*”. WP 00-38 (16). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M. “*Nonparametric Testing of Common Stochastic Trends in Pairs of Univariate Time Series Using Induced-Order Statistics*”. WP 00-39 (17). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García, A. “*A Robust Nonparametric Test for Dominant Low-Frequency Behavior in Time Series*”. WP 00-40 (18). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M., Arranz, M.A. y Escribano, A. “*A model-free cointegration approach for pairs of $I(d)$ variables*”. WP 00-59 (24). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Aparicio, F.M. “*Universidad y sociedad en los albores del 2000*”. DT 00-06 (02). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Arranz, M.A. y Escribano, A. “*A note on COMFAC restriction in ECM testing under co-breaks*”. WP 00-58 (23). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Espasa, A. y Cancelo, J.R. *“Análisis cuantitativo de los precios de la vivienda: Principales resultados e implicaciones sobre el funcionamiento del mercado de la vivienda en España”*. DT 00-02 (01). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Esteban-Bravo, M., Gourdel, P. y Prieto, Fco. J. *“Existence and Computation of an Arrow-Debreu Equilibrium”*. WP 00-45 (20). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Esteban-Bravo, M. *“Existence and computation of a Cournot-Walras equilibrium”*. WP 00-60 (25). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Esteban-Bravo, M. *“Existence and computation of GEI equilibrium”*. WP 00-61 (26). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mayoral, L. *“Long Range Dependence in Spanish Political Opinion Poll Series”* WP 00-09 (03). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J. y González, M. y *“A Threshold Unit Root Model (TUR) for Interest Rates”*. WP 00-08 (02). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Hernández, A. y Velilla, S., *“Dimension Reduction in Discriminant Analysis using Transformations”*. WP 00-25 (10). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Hernández, A. y Maydeu-Olivares, A. *“Some remarks on estimating a covariance structure model from a sample correlation matrix”*. WP 00-62 (27). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Lillo, R.E., Belzunce, F., Ruiz, J.M. y Shaked, M. *“Stochastic Comparisons of Nonhomogeneous Processes”*. WP 00-13 (07). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Lillo, R.E. y Martín, M. *“Identifiability of Differentiable Bayes Estimators of the Uniform Scale Parameter”*. WP 00-10 (04). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Lillo, R.E. *“Note on Characterization Problem of Nagaraja and Nevzorov”*. WP 00-11 (05). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Lillo, R.E. y Martín, M. *“Characterizations Involving Conditional Expectations Based on a Functional Derivative Approach”*. WP 00-12 (06). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Lillo, R.E., Nanda, Asok K. y Shaked, M. *“Preservation of Some Stochastic Orders by Order Statistics”*. WP 00-14 (08). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Mármol, F.L. y Velasco, C. *“Trend Stationarity Versus Long Range Dependence In Time Series Analysis”*. WP 00-37 (15). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Martínez-Moguerza, J. y Prieto, Fco. J. *“An Augmented Lagrangian Interior-Point Method Using Directions of Negative Curvature”*. WP 00-36 (14). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Peña, D. *“An Interview to George Box”*. WP 00-30 (13). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Peña, D. y Poncela, P. *"Forecasting with Nonstationary Dynamic Factor Models"*. WP 00-49 (21). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Peña, D. y Rodríguez, J. *"A Descriptive Measure of Multivariate Dependency"*. WP 00-50 (22). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Romera, R. y Hernández-Lerma, O. *"Pareto Optimality in Multiobjective Markov Control Processes"*. WP 00-28 (11). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Ruiz, E., Hernández, N. y Pañeda, C. *"Relaciones dinámicas en el mercado internacional de carne de vacuno"*. DT 00-07 (03). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

Sperlich, S., Härdle, W., y Spokoiny, V. *"Structural Tests in Additive Regression"*. WP 00-16 (09). Serie de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid.

VII. CONGRESOS, CONFERENCIAS Y SEMINARIOS.

VII. MEETINGS AND CONFERENCES ATTENDED

Presentaciones en congresos

Meetings

1999

Alonso-Borrego, C. y Collado, M^a D. "Factor demands and innovation activity: evidence from Spanish manufacturing firms", **Econometric Society European Meeting**, Santiago de Compostela (España).

Alonso-Borrego, C. y Collado, M^a D. "Factor demands and innovation activity: evidence from Spanish manufacturing firms", **Programa de Investigaciones Económicas de la Fundación Empresa Pública**, Madrid (España).

Aparicio, F.M. y Escribano, A. "Synchronicity Between Economic Variables: An Exploratory Analysis", **Nonlinear Modelling of Multivariate Macroeconomic Relationships**, Rotterdam (Holanda).

Aparicio, F.M. y Escribano, A. "Linear and Nonlinear Cointegration", **Institute for Advance Studies**, Viena (Austria).

Aparicio, F.M. y Escribano, A. "Searching for Linear and Nonlinear Cointegration", **19th International Symposium on Forecasting**, Washington (EE.UU).

Delgado, M.A. e Hidalgo, J. "Bootstrap goodness-of-fit tests for FARIMA models", **XVII Latinoamerican Meeting of the Econometric Society**, Cancún (Méjico).

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", **Econometric Society European Meeting**, Santiago de Compostela (España).

Delgado, M.A. e Hidalgo, J. "Bootstrap goodness-of-fit tests for FARIMA models", **New Developments in Time Series Econometrics**, Cowles Foundation Econometrics Conference, Yale (USA).

Espasa, A., Lorenzo, F., Poncela, P. y Senra, E. "Modelling inflation: experience with US and Spanish data", **European Meeting of the Econometric Society**, Santiago de Compostela (España).

Espasa, A. "Modelos econométricos no lineales para el análisis de los ciclos económicos en España y EE.UU.", Conferencia invitada en el **5º Encontro Galego de Novos Investigadores de Análise Económica**, La Coruña (España).

Espasa, A. y Cancelo, J.R. "Las previsiones de precios de la vivienda en España y su influencia en las expectativas: el estado de la cuestión", **Jornadas sobre precios de la vivienda**, Ministerio de Fomento, Madrid (España).

Gonzalo, J. y González, M. "Inference and estimation of threshold error correction models", **Winter Meetings de la North-American Econometric Society**, New York (EE.UU.).

Gonzalo, J., Mayoral, L. y Dolado, J.J. "Fractional Dickey-Fuller test", **Congreso ESEM'99**, Santiago de Compostela (España).

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "Threshold stochastic unit root models", **Congreso ESEM '99**, Santiago de Compostela (España).

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mayoral, L. "A fractional Dickey-fuller test", **Cowles Foundation Conference in Econometrics**, Yale (EE.UU.).

Kaiser, R. y Maravall, A. "Seasonal Outliers in time series", **Empirical comparison of seasonal adjustment method** (Bundesbank), Frankfurt (Alemania).

Kaiser, R. y Maravall, A. "A reflexion on direct versus indirect adjustment from a model-based perspective", Alternative seasonal Adjustment methods and the aggregation of EMU quarterly national accounts. **German Institute for Economic Research**, Berlin (Alemania).

Kaiser, R. y Maravall, A. "Short-term and long-term trends, seasonal adjustment and the business cycle: the Hodrick-Prescott filter reconsidered", **Workshop on Cyclical Indicators for the European Economics**. Banco de Italia, Roma (Italia).

Mármol, F.L. y Ariño, M.A. "A Beveridge-Nelson decomposition for fractionally integrated processes", **XIX International Symposium in Forecasting**, Washington (USA).

Mármol, F.L., Escribano, A. y Aparicio, F. "Estimation and Testing in Fractional Cointegrating Regressions", **Institute for Nonlinear Studies**, Aarhus (Dinamarca).

Mármol, F.L., Escribano, A. y Aparicio, F.M. "A new instrumental variable estimator for estimating and testing cointegration relationships", **XIX International Symposium in Forecasting**, Washington (USA).

Mármol, F.L. Escribano, A. y Aparicio, F.M. "A new instrumental variable estimator for estimating and testing cointegration relationships", **Congreso ESEM '99**, Santiago de Compostela (España).

Mármol, F.L. y Granger, C.W. "The correlogram of a long memory process plus a simple noise", **Congreso de Series Temporales**, Dortmund (Alemania).

Mármol, F.L. y Hassler, U. "Fractional cointegration in the presence of linear time trends", **Congreso de Series Temporales**, Dortmund (Alemania).

Mármol, F.L. y Krämer, W. "The power of residual-based tests for cointegration when residuals are fractionally integrated", **Congreso ESEM '99**, Santiago de Compostela (España).

Peña, D. "Building linear quality indices", **Congreso de American Society for Quality**, Los Angeles (EE.UU.).

Prieto, F.J. y Martínez, J. "Interior-point methods using negative curvature", **1st. Workshop on Nonlinear Optimization**, Coimbra (Portugal).

Romera, M.R. y Ruiz, E. "Asymmetric observation errors in optimal control of stochastic quadratic linear systems and application to modelling volatility", **CEFES '99**, Boston (USA).

Romo, J.J., Pascual, L. y Ruiz, E. "On bootstrap predictive inference for ARIMA processes", **ASA and IMS Joint Statistical Meetings**, Baltimore (EE.UU.).

Ruiz, E. y Pérez, A. "Finite sample properties of a QML estimator of stochastic volatility models with long memory", **EC2**, Madrid (España).

Sperlich, S. "Semiparametric estimation in GAM and its application in simultaneous equation systems", **WIAS y Universidad Humboldt**, Berlín (Alemania).

Sperlich, S. Fernández; A.I. y Rodríguez-Poo, J.M. "Semiparametric three step estimation methods in labor supply models", **ESEM '99**, Santiago de Compostela (España).

Velasco, C. "Gaussian semiparametric estimation of fractional cointegration", **Econometric Society European Meeting. ESEM**, Santiago de Compostela (España).

Velasco, C. "Nonparametric frequency domain analysis of non-stationary multivariate time series", **Cowles Econometrics Conference "New Developments in Time series Econometrics"**. Universidad de Yale, New Haven (EE.UU.).

Velilla, S. "Variable deletion and bootstrapping in linear regression", **159th Annual Meeting of the American Statistical Association**, Baltimore, (EE.UU.).

Wolf, M. "Subsampling confidence intervals for the autoregressive root", **ESEM99**, Santiago de Compostela (España).

2000

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", **Canadian Econometric Study Group**, Guelph (Canadá).

Delgado, M.A. "A smooth hoeffding blum-kiefer rosenblatt test for serial independence between nonparametric regression errors", **Workshop on nonparametric, semiparametric and resampling methods**, Madrid (España).

Espasa, A. Mesa Redonda sobre "La investigación en economía aplicada en España", **Jornada Conmemorativa del XV aniversario de la Fundación de Estudios de Economía Aplicada**, Madrid (España).

Espasa, A. "Forecasting EMU inflation: A disaggregated approach by countries and components", **Internal Seminar en el Banco Central Europeo**, Frankfurt (Alemania).

Espasa, A., Albacete, R. y Senra, E. "Forecasting EMU inflation: a disaggregated approach by countries and components", **Congreso Internacional "The EURO -what's in the future?"**, Venecia (Italia).

Espasa, A. y Senra, E. "The bottom-up approach in forecasting inflation in Spain. Economic and Statistical Reasons and Policy Implications", **20th. International Symposium on Forecasting**, Lisboa (Portugal).

Gonzalo, J. y Pitarakis, Jean-Yves "Model selection in multiple thresholds model", **Conference on Non-linear and long-memory models**, Cardiff (País de Gales).

Gonzalo, J. y Wolf, M. "Subsampling for threshold models", **Conference on Non-linear and long-memory models**, Cardiff (País de Gales).

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mayoral, L. "A fractional Dickey-fuller test", **Winter Meetings of the North-American Econometric Society Meetings**, Boston (EE.UU.).

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mayoral, L. "Long-range dependence in Spanish political poll series", **Eighth World Congress of the Econometric Society**, Seattle (EE.UU.).

Peña, D., Keynote speaker "Forecasting multivariate time series", **International Forecasting Meeting**, Lisboa (Portugal).

Peña, D., "Measuring the advantages of multivariate forecasts", **Cursos de L'Arrabida**, Lisboa (Portugal).

Peña, D. Keynote speaker "Forecasting with factor models", **Rencontre Franco-Belge de statistique**, Bruselas (Bélgica).

Prieto, Fco. J. y Martínez-Moguerza, J. "Interior point methods for nonconvex problems using line searches", **APMOD 2000**, Londres (Reino Unido).

Prieto, Fco. J. y Martínez-Moguerza, J. "A non-convex interior point method based on gradient fields", **ISMP 2000 –17th International Symposium on Mathematical Programming**, Atlanta (U.S.A).

Romo, J.J., Alonso, A. y Peña, D. "Técnicas de remuestreo y datos omitidos", **XXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa**, Vigo (España).

Romo, J.J., Pascual, L. y Ruiz, E. "Intervalos de predicción bootstrap en modelos ARIMA", **XXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa**, Vigo (España).

Romo, J.J., Peña, D. y Alonso, A. "Missing values resampling in time series", **V World Meeting of the Bernoulli Society**, Guanajuato (México).

Romo, J.J., Peña, D. y Alonso, A. "Sieve bootstrap prediction intervals", **COMPSTAT'2000, 14th Symposium in Computational Statistics 2000**, Utrecht (The Netherlands).

Ruiz, E., Carnero, M.d. y Peña, D. "Outliers in ARCH models", **XXV Congreso de SEIO**, Vigo (España).

Ruiz, E. y Pérez, A. "Finite sample properties of a QML estimator of stochastic volatility models with long memory", **XXV Congreso de SEIO**, Vigo (España).

Ruiz, E. y Pérez, A. "Finite sample properties of a QML estimator of stochastic volatility models with long memory", **20th International Symposium on Forecasting**, Lisboa (Portugal).

Ruiz, E., Romo, J.J. y Pascual, L. "Effects of parameter estimation on prediction densities: a bootstrap approach", **XXV Congreso de SEIO**, Vigo (España).

Ruiz, E., Romo, J.J. y Pascual, L. "Effects of parameter estimation on prediction densities: a bootstrap approach", **20th International Symposium on Forecasting**, Lisboa (Portugal).

Velilla, S. y Hernández, A. "A result on the robustness of Fisher's linear discriminant rule", **5th World Congress of the Bernoulli Society**, Guanajuato (México).

Wiper, M.P., Pettit, L.I. y Young, K.D.S. "Inferencia bayesiana para algunos modelos de Lanchester", **XXV Congreso del SEIO**, Vigo (España).

Conferencias y seminarios impartidos

Conferences and seminars

1999

Alonso-Borrego, C. y Aguirregabiria, V. "Labor contracts and flexibility: evidence from a labor market reform in Spain", Departamento de Fundamentos del Análisis Económico de la *Universidad de Alicante* (España).

Alonso-Borrego, C. y Aguirregabiria, V. "Labor contracts and flexibility: evidence from a labor market reform in Spain", Departamento de Fundamentos del Análisis Económico de la *Universidad de Oviedo* (España).

Delgado, M.A. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en la *London School of Economics, Londres (Reino Unido)*.

Delgado, M.A. "Bootstrap goodness-of-fit tests for FARIMA models", Seminario impartido en *INRA-CREST, Toulouse (Francia)*.

Delgado, M.A. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en *Tilburg University (Holanda)*.

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en *Indiana University, Bloomington, Indiana (USA)*.

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en *Texas A&M University, College Station (USA)*.

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en *Rice University, Houston, Texas (USA)*.

Delgado, M.A. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", Seminario impartido en la *Universidad de Roma, Ente Euniani (Italia)*.

Gonzalo, J. "Threshold unit root models", Departamento de Economía de la *Universidad de Bruselas* (Bélgica).

Gonzalo, J. y González, M. "Inference and estimation of threshold error correction models", Departamento de Economía de *Boston University* (EE.UU).

Gonzalo, J. y González, M. "Inference and estimation of threshold error correction models", Seminario impartido en el *Boston College* (EE.UU).

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "Threshold stochastic unit root models", Departamento de Economía de la *Universidad de Reading* (Reino Unido).

Kaiser, R. y Maravall, A. "Trend, seasonality and economic cycles. The Hodrick-Prescott paradigm revisited", *International Seminar on business cycle analysis. Bank of Italy, Roma (Italia)*.

Mármol, F.L. "Procesos de memoria larga", Seminario en el *Departamento de Estadística y Econometría Universidad Carlos III de Madrid* (España).

Peña, D. "Influencia y sensibilidad en modelos econométricos", *Universidad Autónoma de Barcelona, Barcelona (España)*.

Peña, D. "Prediction with factor models", *Universidad de Viena (Austria)*.

Peña, D. "Outliers in multivariate time series", *Seminario impartido en la Universidad de Chicago (EE.UU.)*

Romo, J.J. "Métodos de remuestreo", Conferencia impartida en la Universidad Nacional de Educación a Distancia, *Avila (España)*.

Romo, J.J. "Bootstrap in time series", Conferencia impartida en el Departamento de Economía de la Universidad de Alicante, *Alicante (España)*.

Romo, J.J., Pascual, L. y Ruiz, E. "Predictive inference for autoregressive processes: a standard bootstrap approach", Seminario del Departamento de Economía de la *Universidad de Cantabria, Santander (España)*.

Romera, M.R. y Ruiz, E. "Linear Systems: estimation and control with asymmetric observations", Seminario en el Departamento de Matemáticas y Estadística. *Universidad de Concordia, Montreal (Canadá)*.

Ruiz, E. "Modelos para series temporales heterocedásticas", Seminario del Departamento de Economía de la *Universidad de Valladolid (España)*.

Sperlich, S. "Backfitting and marginal integration- similarities and differences", *Inst. F. Statistik und Ökonometrie, Universidad Humboldt, Berlín (Alemania)*.

Sperlich, S., Fernández, A.I. y Rodríguez-Poo, J.M. "Semiparametric three step estimation methods in labor supply models", Departamento de Estadística y Econometría, *Universidad Carlos III de Madrid (España)*.

Sperlich, S., Fernández, A.I. y Rodríguez-Poo, J.M. "Semiparametric three step estimation methods in labor supply models", Facultad de Matemáticas. *Universidad Heidelberg (Alemania)*.

Sperlich, S. y Profit, S. "Non-uniformity of job-matching in a transition economy -a non-parametric analysis for the Czech Republic", Departamento de Economía, *Universidad Carlos III de Madrid (España)*.

Sperlich, S., Härdle, W, Huet, S. y Mammen, E. "Semiparametric additive indices for binary response and GAM", Facultad de Matemáticas. *Universidad Ruhr, Bochum (Alemania)*.

Wiper, M.P. "Mixturas de distribuciones gamma con aplicaciones", Seminario en la *Universidad de Valencia (España)*.

2000

Gonzalo, J. y González, M. "A TUR model for interest rates", *Seminario impartido en el CIMAT, Guanajuato (México)*.

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "A threshold stochastic unit root models", *Seminario impartido en la Universidad Complutense de Madrid, Madrid (España)*.

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "A threshold stochastic unit root models", *Seminario impartido en la Universidad de Zaragoza, Zaragoza (España)*.

Gonzalo, J. y Montesinos, R. "A threshold stochastic unit root models", *Seminario impartido en el CIMAT, Guanajuato (México)*.

Gonzalo, J. y González, M. "A threshold stochastic unit root models", *Seminario impartido en el Boston College, Boston (EE.UU.)*.

Peña, D. "Projection pursuit clustering", *Seminario impartido en el Trinity College, Dublín (Alemania)*.

Peña, D. Invited speaker "New procedures for multivariate outlier detection and clustering", *Workshop on Stochastic Complexity en el Oberwolfach Institute (Alemania)*.

Velilla, S. "Variable deletion and bootstrapping in linear regression", *Seminario del Departamento de Economía, Universitat Pompeu Fabra, Barcelona (España)*.

Wiper, M.P. y Ausin, M.C. "Inferencia para colas M/G", *Seminario impartido en la Universidad Rey Juan Carlos I, Madrid (España)*.

Estancias en otros centros

Visits to other Departments

1999

Gonzalo, J.

"Efectos de shocks en sistemas dinámicos" en Boston College (EE.UU.) financiado parcialmente por la DGYCIT(PB950298). Duración: 2/01/99 a 17/01/99.

"Estimación del número de thresholds" en University of Reading (Reino Unido) financiado parcialmente por la DGYCIT(PB950298). Duración: 10/07/99 a 24/07/99.

Kaiser, R.

"Ajuste estacional en los bancos centrales europeos" en el Servicio de Estudios de la Banca d'Italia financiado por la OTRI (Universidad Carlos III de Madrid). Duración: 1/07/99 a 31/07/99.

Peña, D.

"Series temporales" en la Universidad de Chicago (EE.UU.) financiado por NSF (EE.UU) y CICYT. Duración: 1/07/99 a 31/08/99.

Romera, M^a Rosario

"Robustez en Credibilidad" en la Universidad Concordia de Montreal (Canadá) financiado por el Departamento de Matemáticas y Estadística. Duración: 27/06/99 a 11/07/99.

Wiper, M.P.

"Inferencia bayesiana para modelos de tipo Lanchester" en Goldsmiths, Universidad de Londres (Reino Unido) financiado por el Ministerio de Educación. Duración: 17/07/99 a 26/07/99.

Sperlich, S.

Varios artículos, conferencia y libro con W. Härdle, M. Müller, St. Profit en la Universidad Humboldt y WIAS (Alemania) Duración: 22/12/98 a 9/01/99.

"Nonparametric methods in finance and insurance" con C. Tanggard, J.P. Nielsen. En la Business School of Aarhus, Copenhagen (Dinamarca) financiado como un proyecto Bilateral. Duración: 25/03/99 a 31/03/99.

"Métodos semiparamétricos en modelos de mercados laborales" con J. Rodríguez-Poo, A.I. Fernández, Ph. Vieu. en la Universidad Cantabria, Santander (España) financiado por la Universidad de Santander. Duración: 19/05/99 a 24/05/99.

Dos artículos y libro con W. Härdle, M. Müller, A. Werwatz, E. Mammen, L. Yang. en la Universidad Humboldt de Berlín (Alemania) financiado por SFB 373, Universidad Humboldt. Duración: 5/07/99 a 14/07/99.

"Contrastes en modelos aditivos" con H. Dette, A. Munk. en la Universidad Ruhr, Bochum (Alemania) financiado por la Universidad Ruhr. Duración: 14/07/99 a 16/07/99.

"Semiparametric Additive Indices, Generalized Additive Models" con E. Mammen en la Universidad Heidelberg (Alemania) financiado por la Universidad Heidelberg. Duración: 16/07/99 a 23/07/99.

2000

Gonzalo, J.

"Efectos de shocks a diferentes niveles de agregación" en el Boston College (EE.UU.) financiado parcialmente por la DGYCIT (PB98-0026). *Duración:* 9/1/2000 a 16/1/2000.

"Modelos no-lineales con barreras absorbentes" en el Centro de Investigación Matemática (CIMAT) –México- financiado por la CIMAT. *Duración:* 15/5/2000 a 30/5/2000.

"Selección de modelos no-lineales" en la University of Reading (Reino Unido) financiado por la University of Cardiff y University of Reading. *Duración:* 10/7/2000 a 17/7/2000.

Sperlich, S.

"Nonparametric methods in separable models" con Oliver B. Linton de la London School of Economics (LSE) -Reino Unido- financiado por la Danish Social Science Research Fund. *Duración:* 16/5/2000 a 19/5/2000.

"Semiparametric forecasting of Stock Yields" con Jens Perch Nielsen de Codan Insurance Copenhagen (Dinamarca) financiado por la Danish Social Science Research Fund. *Duración:* 19/5/2000 a 21/5/2000.

"Semiparametric estimation of weak and strong separable models; testing and estimation of derivatives in generalized additive models" en la Universidad Humboldt de Berlin (Alemania) financiado por SFB 373. *Duración:* 15/6/2000 a 24/6/2000.

"Semiparametric estimation of weak and strong separable models; bootstrap inference in generalized additive models" con Enno Mammen de la Universidad de Heidelberg (Alemania) financiado por DFG Projekt MA 1026/6-2, Universidad de Heidelberg. *Duración:* 3/7/2000 a 10/7/2000.

"Semiparametric 3 step estimation methods in labor markets; testing of additivity" con Holger Dette, Axel Munck de la Universidad Ruhr, Bochum y Universidad de Dortmund (Alemania) financiado por SFB 475. *Duración:* 10/7/2000 a 13/7/2000.

"Controlling complexity for strong stochastic" en Mathematisches Forschungszentrum Oberwolfach (Alemania) financiado por DGE PB98-0025 y Oberwolfach. *Duración:* 10/9/2000 a 16/9/2000.

**VIII. SEMINARIOS IMPARTIDOS EN
EL DEPARTAMENTO**

VIII. DEPARTMENT SEMINARS

1999

ANDRÉS M. ALONSO FERNÁNDEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Técnicas de remuestreo y datos omitidos”*. 15 de enero de 1999.

M^a ANGELES CARNERO FERNÁNDEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Observaciones atípicas en series temporales heterocedásticas”*. 15 de enero de 1999.

ANA CRIADO BONILLA (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Teoría asintótica local en procesos fraccionales”*. 15 de enero de 1999.

CHRISTIAN P. ROBERT (CREST). *“The simulated likelihood ratio (SRL) method”*. 21 de enero de 1999.

ANA GARCÍA SIPOLS (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Análisis de cointegración y comovimientos mediante reconocimiento de patrones”*. 29 de enero de 1999.

OSCAR MARTÍNEZ IBÁÑEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Asimetrías y persistencia: ¿el tamaño importa?”*. 29 de enero de 1999.

SILVIA QUINTÁS (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Selección robusta de variables en modelos de regresión”*. 29 de enero de 1999.

G. DON TAYLOR (Universidad de Arkansas). *“Optimization and simulation methods supporting distributed manufacturing”*. 5 de febrero de 1999.

ANDRÉS REDCHUK (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Modelos y algoritmos de optimización para el estudio de mercados eléctricos competitivos”*. 12 de febrero de 1999.

DOMINGO DE GUZMÁN SORIA MARTÍN (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Estudio y desarrollo de algoritmos y técnicas de descomposición para problemas no lineales enteros mixtos y su aplicación al sector eléctrico”*. 12 de febrero de 1999.

M. DOLORES REDONDAS MARRERO (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Promedio Bayesiano de modelos: aplicaciones a series temporales”*. 12 de febrero de 1999.

ANDRÉS UBIERNA GORRICO (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Contrastes de bondad de ajuste para series temporales”*. 12 de febrero de 1999.

RICARDO FRAIMAN (Universidad de Montevideo). *“Kernel-based functional data analysis”*. 19 de febrero de 1999.

AGUSTÍN MARAVALL (Banco de España). *“Short-term and long-term trends, seasonal adjustment and the business cycle”*. 26 de febrero de 1999.

STEFAN SPERLICH (Universidad Carlos III de Madrid). *“Semiparametric three step estimation methods in labor supply models”*. 5 de marzo de 1999.

IRWIN GUTTMAN (Universidad de Buffalo). *“EB estimators, EM algorithms and the collapsing effect in one way A of V situations”*. 12 de marzo de 1999.

RICHARD A. JOHNSON (Universidad de Wisconsin). *“A new family of power transformations to improve normality or symmetry”*. 15 de marzo de 1999.

MARK STEEL (University of Edinburgh). *“A bayesian analysis of multiple-output production frontiers”*. 9 de abril de 1999.

R. J. BHANSALI (University of Liverpool). *“Parameter estimation and model selection for multistep prediction of a time series: a review”*. 16 de abril de 1999.

JOHN HASLETT (Trinity College. University of Dublin). *“Simple derivation-subset deletion diagnostics”*. 23 de abril de 1999.

OLIVIER NUÑEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *“Identificabilidad en los modelos de mixtura”*. 7 de mayo de 1999.

GEORGE BOX (University of Wisconsin). *“Some thoughts in statistics and quality”*. 10 de mayo de 1999.

LORI A. THOMBS (University of South Carolina). *“Resampling techniques for time series modeling”*. 14 de mayo de 1999.

INMACULADA FITENI (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *“Inferencia, modelos con cambio estructural”*. 17 de mayo de 1999.

BENEDIKT M. POETSCHER (University of Viena). *“Lower risk bounds for ill-posed estimation problems with an application to spectral estimation, estimation of persistence and long memory”*. 21 de mayo de 1999.

THIERRY MAGNAC (CREST). *“Collective labor supply: heterogeneity and nonparticipation”*. 28 de mayo de 1999.

LUC BAUWENS (CORE). *“The stochastic conditional duration model: a latent factor model for the analysis of financial durations”*. 4 de junio de 1999.

JOSÉ M. VIDAL (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de tesis: *“Consistencia universal de estimadores delta. Un enfoque basado en teoría de la aproximación”*. 13 de julio de 1999.

SONIA HERNÁNDEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de tesis: *“Estimadores de regresión local y globalmente robustos”*. 4 de octubre de 1999

JACEK GONDZIO (University of Edimburgh). *“Decomposition with interior point methods: applications in Asset liability modeling”*. 8 de octubre de 1999.

LEANDRO PARDO (Universidad Complutense de Madrid). *“Técnicas inferenciales en modelos log-lineales basados en phi-divergencias”*. 15 de octubre de 1999.

UWE HASSLER (Free University of Berlin). *“The effect of linear time trends on single equation cointegration testing”*. 22 de octubre de 1999.

PEDRO DELICADO (Universitat Pompeu Fabra). *“Another look at principal curves and surfaces”*. 28 de octubre de 1999.

MARTA MORENO WARLETA (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *“Remuestreo en contrastes robustos para raíces unitarias”*. 11 de noviembre de 1999.

OLIVER B. LINTON (London School of Economics). *“Estimating yield curves by kernel smoothing”*. 12 de noviembre de 1999.

JOAN DEL CASTILLO (Universitat Autònoma de Barcelona). *“Modelos exponenciales con aplicaciones”*. 19 de noviembre de 1999.

ARTURO KOHATSU (Universitat Pompeu Fabra). *“Portfolio stability with respect to volatility miss-specifications”*. 26 de noviembre de 1999.

JUAN MORA (Universidad de Alicante). *“Non-parametric tests for serial independence of errors in regression models”*. 3 de diciembre de 1999.

OSCAR JORDÁ (University of California, Davis). *“The transmission of monetary policy via announcement effects”*. 10 de diciembre de 1999.

MARIA DURBAN (Universidad de Edimburgo). *“Algunos aspectos teóricos de modelos semiparamétricos y aplicaciones en experimentos de campo”*. 21 de diciembre de 1999.

2000

REBECA ALBACETE (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Modelización macroeconómica a nivel europeo con fines de predicción y diagnóstico a corto plazo”*. 14 de enero de 2000.

CONCEPCIÓN AUSIN (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Inferencia bayesiana en sistemas de colas”*. 14 de enero de 2000.

CARMEN BROTO (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Relaciones dinámicas entre nivel e incertidumbre en series temporales”*. 14 de enero de 2000.

PEDRO GALEANO (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Projection pursuit en series temporales multivariantes”*. 21 de enero de 2000.

ARSINOÉ LAMADRIZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Reducción de la dimensión vía modelos aditivos o modelos de un solo índice”*. 21 de enero de 2000.

JOSÉ LUIS PÉREZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Métodos de aproximación de soluciones de problemas de optimización en tiempo continuo”*. 21 de enero de 2000.

URSULA GATHER (Dortmund University). *“Robust dimension reduction in regression models”*. 28 de enero de 2000.

ROCÍO SÁNCHEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Un modelo dinámico estructural de la decisión de inversión bajo irreversibilidad e incertidumbre”*. 4 de febrero de 2000.

MIRYAM SANTOS (Universidad Carlos III de Madrid). Propuesta de tesis: *“Técnicas de remuestreo para contrastes en series temporales”*. 4 de febrero de 2000.

XIAOHONG CHEN (London School of Economics). *“Efficient estimation of models with conditional moment restrictions containing unknown functions”*. 11 de febrero de 2000.

PEDRO VALLS (Universidad de Sao Paulo). *“Alternative models to extract asset volatility: a comparative study”*. 18 de febrero de 2000.

PEDRO MIRA (CEMFI). *“Swapping the nested fixed point algorithm: a general class of estimators for discrete Markov models”*. 25 de febrero de 2000.

ONÉSIMO HERNÁNDEZ (CINVESTAV-IPN). *“Control óptimo, control con objetivos múltiples, teoría de juegos, etc.”*. 10 de marzo de 2000.

VÍCTOR YOHAI (Universidad de S. Andrés. Argentina). *“Un nuevo enfoque computacional para análisis bayesiano clásico y robusto”*. 15 de marzo de 2000.

DAVID NUALART (Universidad de Barcelona). *“Movimiento browniano fraccionario: Cálculo estocástico y aplicaciones en matemáticas financieras”*. 17 de marzo de 2000.

KIRILL ILLINSKI (Universidad de Birmigham). *“Statistical properties of a stock market index in the high-frequency regime and its microscopic modelling”*. 24 de marzo de 2000.

JOE ROMANO (Stanford University). *“Finite sample nonparametric inference and large sample efficiency”*. 31 de marzo de 2000.

HENRIK GZYL (Universidad Simón Bolívar). *“Aspectos genéricos de valoración de derivadas”*. 11 de abril de 2000.

HOLGER DETTE (Ruhr- University Bochum). *“A consistent test for the functional form of a regression based on a difference of variance estimators”*. 28 de abril de 2000.

PHILIP HANS FRANSES (Erasmus University of Rotterdam). *“Censored latent effects autoregression with an application to US unemployment”*. 5 de mayo de 2000.

JUAN RODRÍGUEZ-POO (Universidad de Cantabria). *“Semiparametric estimation of strong, weak and non separable models”*. 12 de mayo de 2000.

RICHARD SMITH (Bristol University). *“Approximations to the distribution of conditional moment tests”*. 19 de mayo de 2000.

FCO. JAVIER NOGALES (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *“Resolución distribuida de problemas de optimización no lineal de gran tamaño”*. 26 de mayo de 2000.

JAVIER MARTÍNEZ MOGUERZA. (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *“Métodos de punto interior para optimización no convexa”*. 31 de mayo de 2000.

JUAN CUESTA (Universidad de Cantabria). *“La distribución asintótica de la media bootstrap de un arreglo triangular”*. 2 de junio de 2000.

LAURA MAYORAL (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *“Técnicas de estimación y contraste para procesos fraccionalmente integrados”*. 6 de junio de 2000.

J. PETER KREISS (Technische Universität Braunschweig). *“Bootstrap of kernel smoothing in nonlinear time series”*. 9 de junio de 2000.

ARNOLD ZELLNER (GBS. University of Chicago). *“Bayesian modeling and data requirements”*. 14 de junio de 2000.

YANIS YATRACOS (Nationale University of Singapore). *“Clusters, variance, regression and projection pursuit”*. 16 de junio de 2000.

JOSE MANUEL MARTÍNEZ (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis:
*“Modelos univariantes para el análisis de los ciclos económicos en España y EE.UU.
Modelos econométricos para funciones de demanda desagregada de las importaciones
españolas con un estudio de la no-linealidad cíclica”*. 6 de julio de 2000.