

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
- Licenciatura en Ciencias Actuariales y Financieras
- Licenciatura en Sociología
- Licenciatura en Ciencias del Trabajo
- Diplomatura en Ciencias Empresariales
- Diplomatura en Gestión y Administración Pública
- Diplomatura en Informática de Gestión
- Diplomatura en Relaciones Laborales
- Diplomatura en Estadística
- Diplomatura en Turismo
- 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 de la Empresa y Métodos Cuantitativos.
- 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
- Licenciatura en Ciencias Actuariales y Financieras
- Licenciatura en Sociología
- Licenciatura en Ciencias del Trabajo
- Diplomatura en Ciencias Empresariales
- Diplomatura en Gestión y Administración Pública
- Diplomatura en Informática de Gestión
- Diplomatura en Relaciones Laborales
- Diplomatura en Estadística
- Diplomatura en Turismo
- 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 de la Empresa y Métodos Cuantitativos.
- 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

2002-2003

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: 2003. 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: 2003. The purpose of this project is to generate a longitudinal database of European households 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 Community Household Panel and a variety of independent national panels.

Alonso-Borrego, C. Participante del Proyecto de Investigación Europeo LABFDI "Labour market effects of foreign direct investments". Año inicio: 2000. Año fin: 2003. Director: Barba, G.. Este proyecto tiene como objetivo estudiar el efecto de la inversión extranjera directa en el empleo, y cómo dicho efecto puede variar en función de las características institucionales del mercado de trabajo. Para ello, se aborda la investigación a varios niveles. Por un lado, se estudiarán dichos efectos a partir de modelos teóricos de inversión extranjera directa. Por otro, se llevarán a cabo estudios empíricos tanto con bases de datos longitudinales de empresas o establecimientos como con bases de datos sectoriales, haciendo especial énfasis en las comparaciones internacionales.

Alonso-Borrego, C. He participates in the european research project "Labour market effects of foreign direct investments". Beginning: 2000. End: 2003. Director: Barba, G. The purpose of this project is to study the empirical 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, economic policy implications will also be studied.

Alonso-Borrego, C. Investigador principal del proyecto de investigación nacional "Modelos dinámicos, regímenes e instituciones. Aplicaciones a mercado de trabajo y organización industrial" financiado por el Ministerio de Ciencia y Tecnología. Año inicio: 2001. Fin: 2003. Participantes: Herrendorf, Berthold, Mora, R. Este proyecto versa sobre la aplicación de modelos de programación dinámica para el estudio de la importancia de los costes de ajuste en las decisiones de los agentes económicos. Aunque el proyecto es de naturaleza fundamentalmente empírica, los objetivos planteados pasan por ofrecer aportaciones teóricas y metodológicas tanto en problemas de demanda de trabajo, inversión bajo incertidumbre, e incorporación de la mujer al mercado de trabajo. Respecto al análisis de la demanda de trabajo, el

Alonso-Borrego, C. Principal research of the project "Dynamic models, regimes and institutions. Applications to labour economics and industrial organization". Participants: Herrendorf, Berthold, Mora, R. Beginning: 2001. End: 2003. This project is concerned with the application of dynamic programming models to the study of the role of adjustment costs in the decisions of economic agents. Although the project is primarily empirical, among the objectives there are also theoretical and methodological contributions in the different applications of labour demand, investment under uncertainty, and the performance of women in the labour market. Regarding the study of labour demand, the aim is to derive a dynamic programming model in a partial equilibrium framework in order to estimate the optimal decision rules

objetivo es desarrollar un modelo de programación dinámica en un contexto de equilibrio parcial y estimar las reglas de decisión óptima para los trabajadores. Asimismo, pretendemos explotar los parámetros estimados para simular los efectos sobre el nivel de empleo de reformas alternativas del mercado de trabajo. En la modelización de la inversión con incertidumbre estudiaremos la calibración y estimación de modelos de adopción de tecnología y modelos de innovación además de sopesar la influencia de la estructura financiera y de la política fiscal en las decisiones de inversión. Finalmente, en el estudio de la incorporación de la mujer al mercado de trabajo, vamos a analizar las implicaciones para la segregación ocupacional y la discriminación salarial contra las mujeres de la existencia de costes de ajuste institucionales y no institucionales en el mercado de trabajo.

Aparicio, F.M. Participante del proyecto nacional "Gestión del riesgo en los mercados financieros" dirigido por Ignacio Peña. Año de inicio: 2000. Año fin: 2002.

Baíllo, A. Participante en el proyecto nacional BFM2001-0169 dirigido por Antonio Cuevas. Año inicio: 2001. Año fin: 2003.

Durbán, M. Participante en el proyecto nacional "Contrastes de especificación de modelos econométricos" bajo la dirección de Miguel Delgado. Participantes: Velasco, C., Sperlich, S., Aráosla, M.J. Hevia, J.de, Wolf, M., Miles, D. y Álvarez, M. Año inicio: 2002. Año fin: 2004.

Espasa, A. Director del "Boletín Inflación y Análisis Macroeconómico". Participantes: Albacete, R., Carrasco, N., García, A., Gaya, P., Lamadriz, A., Mayo, I. Mínguez, R., Muñoz, C., Sánchez, A y Senra, E. 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, bilingüe en castellano e inglés, 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 e Italia basado en datos de panel sobre las encuestas de población activa de dichos países.

for firing and hiring decisions. Furthermore , we will exploit the estimated parameters to simulate the effects on aggregate employment and output of alternative labour market reforms. With respect to investment, we will study the estimation and calibration of models of irreversibility, technology adoption and innovation, and we will also evaluate the influence of financial conditions and tax policy on investment decisions. Finally, in the study of the women in the labour market, we will analyze the implications for occupational segregation and discrimination against females of the existence of both institutional and non-institutional adjustment costs in the labour market.

Aparicio, F.M. He participates in the project "Gestión del riesgo en los mercados financieros" under the direction of Ignacio Peña. Beginning: 2000. End: 2002.

Baíllo, A. She participates in the project BFM2001-0169 under the direction of Antonio Cuevas. Beginning: 2001. End: 2003.

Durbán, M. She participates in the project "Contrastes de especificación de modelos econométricos" under the direction of Miguel Delgado. Participants: Velasco, C., Sperlich, S., Aráosla, M.J. Hevia, J. de, Wolf, M., Miles, D. y Álvarez, M. Beginning: 2002. End: 2004.

Espasa, A. Director of the "Bulletin of E.U. and U.S. inflation and Macroeconomic Analysis." Participants: Albacete, R., Carrasco, N., García, A., Gaya, P., Lamadriz, A., Mayo, I., Mínguez, R., Muñoz, C., Sánchez, A. and Senra, E. Starting: 1994. This monthly publication provides predictions over a period of two years for the E.U. and U.S. inflation rates, 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.

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

Espasa, A. Investigador principal del grupo del Instituto Flores de Lemus en el proyecto "European Forecasting Network" financiado por la D.G. de Economía y Finanzas de la Comisión Europea. Participantes: Boldrin, M., Dolado, J.J., Kaiser, R., Ruiz, E., Albacete, R. Duración: septiembre 2001-septiembre 2003. El objetivo de esta red es mejorar el conocimiento de las políticas y desarrollos económicos en el área, aumentar los fundamentos analíticos para las decisiones de política económica en el área e incrementar la visibilidad de la Unión Económica y Monetaria en los estados miembros. Para ello la EFN realizará informes consensuados, independientes y rigurosos de la situación económica, con la finalidad de identificar los principales retos de política económica en la euro-área. En el proyecto participan otras siete instituciones europeas. La aportación del grupo de la Universidad Carlos III será en diferentes ámbitos: predicción, análisis macroeconómico de las implicaciones de las predicciones y evaluación de políticas económicas, análisis y seguimiento de temas como efectos asimétricos de la política monetaria, políticas factibles sobre reformas de la Seguridad Social europea, diferentes cuestiones sobre el mercado de trabajo y temas metodológicos en el análisis de datos europeos.

Espasa, A. 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. Participantes: Escribano, A., Espasa, A., Peña, D. Se trata de un Proyecto TMR de la CEE otorgado a ocho instituciones académicas europeas para fomentar el estudio de los ciclos económicos en Europa, con especial énfasis en incentivar la movilidad de investigadores doctores. Se trata de un proyecto del Programa de Estudios Sociales y Económicos sobre las reformas de los sistemas públicos de pensiones en los países de la U.E.

Espasa, A. Investigador principal del proyecto "Análisis y predicción macroeconómica de la Comunidad de Madrid". Participantes: Cancelo, J.R., Albacete, R. y Lamadriz, A. Año inicio: 2002. Año fin: 2003. El proyecto consiste en la realización de informes semestrales sobre la economía de la Comunidad de Madrid, basada en predicciones econométricas. El ámbito de

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

Espasa, A. Principal researcher of the group of Instituto Flores de Lemus in the project "European Forecasting Network". Participants: Boldrin, M., Dolado, J.J., Kaiser, R., Ruiz, E., Albacete, R. Duration: september 2001-september 2003. The purpose of the EFN is to improve the understanding of the euro-area economic developments and policies, to augment the analytical basis for economic policy decisions in the euro area and to increase the visibility of Economic and Monetary Union (EMU) in the member states. To achieve these objectives, the EFN will produce independent, rigorous and joint assessments of the economic situation, the aim being to identify key policy challenges in the euro area. In the project participates another seven european institutions. The contribution of the groups from this university will be in different fields as: forecasting, macroeconomic analysis, policy evaluation, monetary policy, social security reforms, labour markets and on different methodological topics and European data analysis.

Espasa, A. participates in the project of the European Union "New Approaches to the study of Economic Fluctuations". The coordinator is Juan José Dolado. Starts in 1997 and ends in the year 2002. Participants: Escribano, A., Espasa, A., Peña, D. This project analyses questions related to economic cycles and growth.

Espasa, A. Principal research of the project "Análisis y predicción macroeconómica de la Comunidad de Madrid". Participants. Cancelo, J.R., Albacete, R. and Lamadriz, A. Beginning: 2002. End: 2003.

los modelos econométricos cubrirán las siguientes variables: producto interior bruto, VAB por sectores, precios, salarios, actividad, ocupación, paro, importaciones y exportaciones.

Espasa, A. Principal investigador del proyecto "Metodología econométrica para la modelización y predicción de series macroeconómicas y financieras". Participantes: Núñez, O., Ruiz, E. y Kaiser, R. Año inicio: 2002. Año fin: 2005.

Espasa, A. Principal investigador de la Cátedra especial de investigación "Fundación Universidad Carlos III: predicción y análisis macroeconómico". Año inicio: 2002. El objetivo de esta cátedra es promover la investigación teórica y la aplicación a las economías española y de la zona euro de las técnicas de predicción con especial orientación al análisis macroeconómico con fines de diagnóstico.

De Hevia, J. Investigador principal del proyecto "Problemas en la estimación del efecto de un tratamiento: Rendimiento de la educación en España". Participantes: Arrazola, M. Financiado por el Instituto de Estudios Fiscales (IEF). Año de inicio: 2001. Año de finalización: 2002. En este proyecto se estudian los problemas que surgen en la estimación del rendimiento de la educación.

De Hevia, J. Investigador principal del proyecto "Medición del capital humano y análisis de su rendimiento". Participantes: Arrazola, M. Financiado por el Instituto de Estudios Fiscales (IEF). Año de inicio: 2002. Año de finalización: 2003. En este proyecto se pretende proponer una medida del capital humano y emplearla en el análisis del rendimiento del capital humano.

Martín, I. Participante del proyecto "Eficacia y seguridad de las asociaciones de antihipertensivos a dosis fijas. Un metaanálisis" dirigido por el Inst. Farmacoepidemiología de la Universidad de Valladolid. Año inicio: 2001. Año fin: 2002. Se trata de un estudio donde se recogen todos los artículos publicados sobre eficacia y seguridad de las asociaciones de fármacos antihipertensivos. Se extrae como variable principal de cada estudio la disminución expresada en mmHg en la presión arterial sistólica (PAS) y diastólica (PAD) de los pacientes en los diferentes períodos de tratamiento. En el metaanálisis se utilizará la diferencia de los valores medios de la disminución en la PAD o PAS en el grupo tratado con la asociación respecto al grupo

Espasa, A. Principal research of the project "Metodología econométrica para la modelización y predicción de series macroeconómicas y financieras". Participantes: Núñez, O., Ruiz, E. and Kaiser, R. Beginning: 2002. End: 2005.

Espasa, A. Principal research for the project of the Fundación Universidad Carlos III de Madrid: "Endowed Research Chair for Forecasting and Macroeconomic Analysis". Starting: 2002. The goal of this chair is to promote theoretical research and the application of forecasting techniques to the Spanish economy an euro zone economy within a european framework, with special consideration to diagnostic tools from macroeconomic analysis.

De Hevia, J. Principal researcher of the project "Problemas en la estimación del efecto de un tratamiento: Rendimiento de la educación en España". Participants: Arrazola, M. Research project funded by IEF. Beginning: 2001. End: 2002. This project studies different methods for the estimation of the returns to education.

De Hevia, J. Principal researcher of the project "Medición del capital humano y análisis de su redimiento". Participants: Arrazola, M. Research project funded by IEF. Beginning: 2002. End: 2003. This project propose a measure of human capital.

Martín, I. He participates in the project "Eficacia y seguridad de las asociaciones de antihipertensivos a dosis fijas. Un metaanálisis" under the direction of Insti. Farmacoepidemiología Universidad de Valladolid. Beginning: 2001. End: 2002.

control, tratado con monoterapia. El metaanálisis consiste en la combinación ponderada de los resultados ofrecidos por los diferentes estudios, ajustando en ocasiones por diferentes factores de riesgo.

Muñoz, A. Investigador principal del proyecto "Eficacia y seguridad de las asociaciones de antihipertensivos a dosis fijas. Un metaanálisis (análisis estadístico)". Año inicio: 2001. Año fin: 2002.

Nogales, F.J. Participante en el proyecto "Grupo de sistemas de energía eléctrica" dirigido por A.J. Conejo de la Universidad de Castilla la Mancha y financiado por la Junta de Comunidades de Castilla-La Mancha, GC-02-006. Año de inicio: 2001. Año fin: 2004.

Núñez, O. Participante en el proyecto de la Consejería de Educación de la Comunidad de Madrid, D.G. Investigación "Trabajo infantil y desigualdad en el acceso a los servicios sanitarios" dirigido por Miguel A. Delgado. Participantes: Álvarez, B., Miles, D. Inicio: 2003. Fin: 2004.

Peña, D. Principal investigador del proyecto nacional TASDEC "Análisis estadístico de grandes bancos de datos económicos y empresariales con estructura compleja" (BEC2000-0167). Participantes: Romo, J.; Velilla, S.; Muñoz, A.; Romera, R.; Prieto, F.J.; Villagarcía, T.; Lillo, R.E.; Sánchez, I.; Wiper, M.; Ausín, C.; Barrios, P.; Alonso, A.; Carnero, M.A.; Galeano, P.; López, S.; Pérez, J.L.; Redondas, M.D.; Santos, M.; Ubierna, A.; Benito, M.; Torrente, A.; Pulido, M.A.; Martín, I. Año de inicio: 2001. Año de fin: 2004. Este proyecto tiene por objeto desarrollar nuevos métodos para analizar grandes bancos de datos económicos y empresariales de estructura compleja. En concreto, pretende alcanzar tres objetivos centrales. 1.- Investigar métodos para identificar la heterogeneidad en un bando de datos. Esta heterogeneidad puede ser debida a la presencia de grupos de observaciones que aparecen como atípicas o a la presencia de clusters en los datos. Se pretende abordar ambos problemas investigando métodos para tratar grupos de datos atípicos tanto en datos estáticos como dinámicos y proponiendo nuevos métodos de clasificación de observaciones. 2.- Desarrollar métodos para reducir la dimensión de estos grandes conjuntos de datos y para visualizarlos mediante proyecciones en espacios de dimensión reducida. En particular, se investigarán técnicas de projection pursuit y no paramétricas para datos estáticos y dinámicos. 3.- Implementar técnicas de computación intensiva para resolver los problemas

Muñoz, A. Principal research of the project "Eficiacia y seguridad de las asociaciones de antihipertensivos a dosis fijas. Un metaanálisis (análisis estadístico). Beginning: 2001. End: 2002.

Nogales, F.J. He participates in the project "Grupo de sistemas de energía eléctrica" under the direction of A.J. Conejo from Universidad Castilla la Mancha and supported by Junta de Comunidades de Castilla-La Mancha, GC-02-006. Beginning: 2001. End: 2004.

Núñez, O. He participates in the project of Consejería Educación de la Comunidad de Madrid, D.G. Investigación "Trabajo infantil y desigualdad en el acceso a los servicios sanitarios". Director: Miguel A. Delgado. Participants: Alvarez, B., Miles, D. Beginning: 2003. End: 2004.

Peña, D. Principal investigator for the DGICYT project "Análisis estadístico de grandes bancos de datos económicos y empresariales con estructura compleja" (BEC2000-0167). Participants: Romo, J.; Velilla, S.; Muñoz, A.; Romera, R.; Prieto, F.J.; Villagarcía, T.; Lillo, R.E.; Sánchez, I.; Wiper, M.; Ausín, C.; Barrios, P.; Alonso, A.; Carnero, M.A.; Galeano, P.; López, S.; Pérez, J.L.; Redondas, M.D.; Santos, M.; Ubierna, A.; Benito, M.; Torrente, A.; Pulido, M.A.; Martín, I. Beginning: 2001. End: 2004. This project aims to develop new procedures for analyzing large data set with complex structure. In particular, it has the following objectives 1.- Find powerful procedures for detecting heterogeneity due to outliers or clusters 2.- Develop procedures for dimension reduction through projection pursuit techniques and no parametric analysis for dynamic and static data 3.- Intensive computer methods to solve these problems, including bootstrap and Marco Chain Monte Carlo methods.

anteriores. Concretamente, se desea investigar métodos de remuestreo y Monte Carlo con cadenas de Markov. Estos últimos métodos han sido aplicados con gran éxito en la estimación bayesiana y se pretende investigar también su utilización para el cálculo de la verosimilitud en problemas complejos donde no es posible acudir a las soluciones tradicionales.

Prieto, F.J. Principal investigador del proyecto "Participación en el panel de expertos para la revisión del proyecto Coconut. Año 2002.

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.

Romera, R. Investigador principal del proyecto "Análisis de sensibilidad en problemas multicriterio de control de procesos markovianos (Sabático). Año: 2002. Financiado por la Universidad Carlos III de Madrid, Programa de Movilidad con la participación de IPN-México.

Romera, R. Principal investigadora del proyecto I+D "SPEEDS" financiado por Minorplanet Systems, S.A. Año inicio: 2001. Año fin: 2002.

Romera, R. Principal investigadora del contrato I+D "SSD-AAPP" financiado por INDRA SISTEMAS; S.A. con la participación de la Universidad Carlos III de Madrid. Año inicio: 2003. Año fin: 2003.

Romo, J.J. Investigador principal del proyecto "Análisis de informativos en cadenas públicas de Televisión y radio". Año inicio: 2002.

Romo, J.J. Investigador principal del proyecto nacional financiado por la DGICYT "Técnicas para el análisis estadístico de datos funcionales en Economía y Empresa". Participantes: Velilla, S. Año de inicio: 2002. Año fin: 2005.

Ruiz, E. Participante en el proyecto europeo "Microestructure of financial markets in Europe" dirigido por Alvaro Escribano. Año inicio: 2002.

Prieto, F.J. Principal research of the project "Participación en el panel de expertos para la revisión del proyecto Coconut. 2002.

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.

Romera, R. Principal research of the project "Análisis de sensibilidad en problemas multicriterio de control de procesos markovianos". 2001. Funded by Universidad Carlos III de Madrid with the participation of IPN-México.

Romera, R. Principal research of the project I+D "SPEEDS" funded by Minorplanet Systems, S.A. Beginning: 2001. End: 2002.

Romera, R. Principal research of the project I+D "SSD-AAPP" funded by INDRA SISTEMAS, S.A., with the participation of Universidad Carlos III de Madrid. Beginning: 2003. End: 2003.

Romo, J.J. Principal research of the project "Análisis de informativos en cadenas públicas de televisión y radio". Beginning: 2002.

Romo, J.J. Principal research of the national project "Técnicas para el análisis estadístico de datos funcionales en Economía y Empresa". Participants: Velilla, S. Beginning: 2002. End: 2005.

Ruiz, E. She participates in the european project "Microestructure of financial markets in Europe" under the direction of Alvaro Escribano. Beginning: 2002.

Sánchez, I. Participante del proyecto “Predicción de la generación eólica en España” dirigido por Julio Usaola. Año inicio: 2001. Año fin: 2002. Modelos de predicción de la producción de energía eólica a partir de datos meteorológicos. El modelo será utilizado por Red Eléctrica de España para regular la distribución de energía a nivel nacional.

Sánchez, I. Participante en el proyecto “Análisis de los efectos de la energía eólica en el mercado eléctrico” dirigido por Julio Usaola. Año inicio: 2002. Año fin: 2003. El objetivo del proyecto es el análisis que el creciente volumen de energía eólica tiene en el mercado eléctrico español dadas las características de no programación ni previsibilidad de dicha energía en contraste con las otras fuentes habituales.

Sánchez, I. Participante en el proyecto de investigación europeo ANEMOS “Development of a next generation wind resource forecasting system for optimal integration of on-shore and off-shore wind farms” bajo la dirección de Kariniotakis L. y Leroy, S. Año inicio: 2002. Año fin: 2005. El objetivo del proyecto es el desarrollo de un sistema de predicción de la producción eléctrica de origen eólico a nivel europeo. Este sistema debería incorporar todos los avances recientes en conocimiento sobre predicción meteorológica, influencia del relieve y condiciones locales de los parques eólicos y técnicas estadísticas espaciales y de series temporales.

Sánchez, I. Participante en el contrato I+D “Mejora del sistema de predicción de la producción eólica y modelos de parques eólicos para estudios de red” dirigido por Julio Usaola y financiado por Red Eléctrica de España. Participantes: Ledesma, P., García, M. Inicio: 2003. Fin: 2004.

Velasco, C. Participante del proyecto “Predicción de la generación eólica en España” dirigido por Julio Usaola. Año de inicio: 2001. Año fin: 2002. Modelos de predicción de la producción de energía eólica a partir de datos meteorológicos. Financiado por Red Eléctrica de España.

Velasco, C. Participante en el proyecto “Análisis de los efectos de la energía eólica en el mercado eléctrico” dirigido por Julio Usaola. Año inicio: 2002. Año fin: 2003. El objetivo del proyecto es el análisis que el creciente volumen de energía eólica tiene en el mercado eléctrico español dadas las características de

Sánchez, I. He participates in the project “Predicción de la generación eólica en España” under the direction of Julio Usaola. Beginning: 2001. End: 2002.

Sánchez, I. He participates in the project “Análisis de los efectos de la energía eólica en el mercado eléctrico” under the direction of Julio Usaola. Beginning: 2002. End: 2003.

Sánchez, I. He participates in the european project “Development of a next generation wind resource forecasting system for optimal integration of on-shore and off-shore wind farms” under the direction of Kariniotakis L. y Leroy, S. Beginning: 2002. End: 2005.

Sánchez, I. He participates in the R+D project: “Improvements of a prediction tool for wind energy and models of wind farms” under the direction of J. Usaola. Beginning: 2003. End: 2004.

Velasco, C. He participates in the project “Predicción de la generación eólica en España” under the direction of Julio Usaola. Beginning: 2001. End: 2002. Funded by Red Eléctrica de España.

Velasco, C. He participates in the project “Análisis de los efectos de la energía eólica en el mercado eléctrico” under the direction of Julio Usaola. Beginning: 2002. End: 2003. Funded by Red Eléctrica de España.

no programación ni previsibilidad de dicha energía en contraste con las otras fuentes habituales.

Velasco, C. Participante en el proyecto de investigación europeo ANEMOS “Development of a next generation wind resource forecasting system for optimal integration of on-shore and off-shore wind farms” bajo la dirección de Kariniotakis L. y Leroy, S. Año inicio: 2002. Año fin: 2005. El objetivo del proyecto es el desarrollo de un sistema de predicción de la producción eléctrica de origen eólico a nivel europeo. Este sistema debería incorporar todos los avances recientes en conocimiento sobre predicción meteorológica, influencia del relieve y condiciones locales de los parques eólicos y técnicas estadísticas espaciales y de series temporales.

Velasco, C. He participates in the european project “Development of a next generation wind resource forecasting system for optimal integration of on-shore and off-shore wind farms” under the direction of Kariniotakis L. y Leroy, S. Beginning: 2002. End: 2005.

V. TESIS DOCTORALES DIRIGIDAS
POR MIEMBROS DEL
DEPARTAMENTO

V.

PH.D.

THESES

2002

Rodríguez, J. *“Contribuciones al estudio de la heterogeneidad y la dependencia”*. Director: Daniel Peña. Universidad Carlos III de Madrid.

2003

Carnero, M.A. *“Heterocedasticidad condicional, atípicos y cambios de nivel en series temporales financieras”*. Directores: Daniel Peña y Esther Ruiz. Universidad Carlos III de Madrid.

Martín-Merino, M. *“Algoritmos para la visualización de datos textuales”* Directores: Alberto Muñoz y Yannis Dimitriadis. Universidad de Salamanca.

Ubierna Gorricho, A. *“Contrastes de bondad de ajuste para series temporales”*. Director: Santiago Velilla. Universidad Carlos III de Madrid.

**VI. PUBLICACIONES Y
DOCUMENTOS DE TRABAJO**

**VI. PUBLICATIONS AND WORKING
PAPERS**

Publicaciones

Publications

2002

Albacete, R., Espasa, A., Senra, E. "Forecasting inflation in the european monetary union: a disaggregated approach by countries and by sectors", *European Journal of Finance*, Vol. 8, pp. 1-20.

Arrazola, M.J. y Hevia, J.d. "An alternative measure of core inflation", *Economics Letters*, Vol. 75, pp. 69-73.

Ausin, M.C., Lillo, R.E., Ruggeri, F. y Wiper, M.P. "Bayesian modeling of hospital bed occupancy times using a mixed generalized Erlang distribution", *Bayesian Statistics*, vol. VII, pp. 443-452.

Conejo, A.J., Nogales, F.J. y Arroyo, J.M. "Price-taker bidding strategy under price uncertainty", *IEEE Transactions on Power Systems*, vol. 17 (4), pp. 1081-1088.

Conejo, A.J., Nogales, F.J. y Prieto, F.J. "A decomposition procedure based on approximate Newton directions", *Mathematical Programming, Ser. A.*, vol. 93 (3), pp. 495-515.

Currie, I. y Durbán, M., "Flexible smoothing with P-splines: a unified approach", *Statistical Modelling*, vol. 8, pp. 48-66.

Dolado, J.J., Gonzalo, J. y Mayoral, L. "A fractional Dickey-Fuller test for unit roots", *Econometrica*, Vol. 70, pp. 1963-2006.

Espasa, A. y Mayo, I. Comentarios sobre "Convergencia y estabilidad en la Unión Europea" de Fernández Macho et al., *Moneda y Crédito*, Vol. 214, pp. 307-320.

Espasa, A., Senra, E. y Albacete, R., "Forecasting EMU inflation: a disaggregated approach by countries and by sectors", *The European Journal of Finance*, v. 8, pp. 402-421.

Espasa, A., "Consideraciones econométricas para el análisis de la coyuntura económica" en Joan del Castillo y David Nualart (eds.) *Seminari de Finances de Barcelona*, curs 2001-02, pp. 35-58.

Glazebrook, K.D., Niño-Mora, J. y Ansell, P.S. "Index policies for a class of discounted restless bandits", *Advances in Applied Probability*, vol. 34, nº 4, pp. 754-774.

Hernández, N., Pañeda, C. y Ruiz, E., "Relaciones dinámicas en el mercado internacional de carne de vacuno", *Revista de Economía Aplicada*, vol. 10, pp. 137-149.

Kaiser, R., Maravall, A. "Seasonal outliers in time series", *Estadística: Journal of the Interamerican Statistical Institute*, Vol. 53.

Lillo, R.E., Belzunce, F., Pellerrey, F. y Shaked, M. "Preservation of association in multivariate shock and claim models", *Operations Research Letters*, vol. 30, pp. 223-230.

Martín, I., Moreno, V., Torres, F., Horas, M., Ríos, J. y González, J.R. "Inverse sampling and triangular sequential designs to compare a small proportion with a reference value", *Quaderns d'Estadística i Investigació Operativa*, Vol. 26, 1-2, pp. 259-271.

Martín-Merino, M. y Muñoz, A. "A new asymmetric topographic mapping algorithm", *Frontiers in Artificial Intelligence and Applications*, vol. 82, pp. 872-878, IOS Press.

Muñoz, A. y Martín-Merino, M. "A new SOM algorithm that visualizes topic hierarchies", *Proceedings of the 6th World Multiconference on Systemics, Cybernetics and Informatics*, pp. 113-118, IIS Press.

Niño-Mora, J. "Dynamic allocation indices for restless projects and queueing admission control: a polyhedral approach", *Mathematical Programming, Series A*, vol. 93 nº 3, pp. 361-413.

Nogales, F.J., Contreras, J., Conejo, A.J. y Espínola, R. "Forecasting next-day electricity prices by time series models", *IEEE Transactions on Power Systems*, vol. 17 (2), pp. 342-348.

Núñez, O. y Concordet, D. "A simulated pseudo-maximum likelihood estimator for nonlinear mixed models", *Computational Statistics & Data Analysis*, Vol. 39/2, pp. 187-201.

Peña, D., Alonso, A., y Romo, J.J. "Forecasting time series with sieve bootstrap", *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol. 100, pp. 1-11.

Peña, D. y Rodríguez, J. "A powerful portmanteau test of lack of fit for time series", *The Journal of American Statistical Association*, pp. 97, 458, 601-619.

Peña, D., Romo, J.J. y Alonso, A. "Una revisión de los métodos de remuestreo en series temporales", *Estadística Española*, Vol. 44, pp. 133-159.

Peña, D. "The major contribution of Professor George P. Box to applied statistics", *Chemometrics and Intelligent Laboratory Systems*, 63, pp. 5-6.

Ruiz, E. y Pérez, A. "Modelos de memoria larga para series económicas y financieras", *Investigaciones Económicas*, Vol. 26, pp. 359-410.

Ruiz, E. y Pascual, L., "Bootstrapping financial time series", *Journal of Economic Surveys*, vol. 16, pp. 271-300.

Sánchez, I. "Efficient forecasting in nearly non-stationary processes", *Journal of Forecasting*, Vol. 21, pp. 1-26.

Tobías, A.M. y Bleda, J. "Aplicación de los modelos de regresión Tobit a las variables epidemiológicas censuradas", *Gaceta Sanitaria*, Vol. 16, pp. 188-195.

Velilla, S., Xia, Y., Tong, H., Li, W.K. y Zhu, L-X. Discussion on "An adaptative estimation of dimension reduction space", *Journal of the Royal Statistical Society, Series B*.

2003

Alonso, A., Peña, D. y Romo, J. "On sieve bootstrap prediction intervals", *Statistics and Probability Letters*.

Alonso, A., Peña, D. y Romo, J. "Introducing model uncertainty in time series bootstrap", *Statística Sínica*.

Alonso, A., Peña, D. y Romo, J. "Resampling time series using missing values techniques", *Annals Inst. Math. Statistics*.

Ansell, P.S., Glazebrook, K.D., Niño-Mora, J., y O'Keeffe, M. "Whittle's index policy for a multi-class queueing system with convex holding costs", *Mathematical Methods of Operations Research* 57, nº 1, pp. 21-39.

Arrazola, M. y de Hevia, J., "Evaluación económica de las políticas educativas. Una ilustración con la Ley General de la Educación de 1970", *Hacienda Pública Española/Revista de Economía Pública*, 164 (1/2003), pp. 111-127.

Baíllo, A., "Total error in a plug-in estimator of level sets", *Statistics and Probability Letters*, vol. 65, pp. 411-417.

Conejo, A.J. Nogales, F.J. y Prieto, F.J., "A decomposition methodology applied to the multi-area optimal power flow problem", *Annals of Operations Research*, vol. 120, pp. 99-116.

Contreras, J., Espínola, R., Nogales, F.J., y Conejo, A.J., "ARIMA models to predict next-day electricity prices", *IEEE Transactions on Power Systems*, vol. 18 (3), pp. 1014-1020.

Delicado, P. y Romo, J. "Random coefficient regressions: parametric goodness-of-fit", *Journal of Statistical Planning and Inference*.

Durbán, M. y Currie, I. "A note on P-spline additive models with correlated errors", *Computational Statistics*, vol. 2, pp. 251-262.

Durbán, M., Hackett, C., McNicol, J.W., "The use of semi-parametric models in field trials", *Journal of Agricultural, Biological and Environmental Statistics*, vol. 2, pp. 333-349.

Espasa, A., "Laudatio on the occasion of the investiture of Professor John Denis Sargan with the degree of Doctor Honoris Causa of the Universidad Carlos III", *Econometric Theory*, v. 19, pp. 435-446.

Moguerza, J.M. y Prieto, F.J. "An augmented Lagrangian interior-point method using directions of negative curvature", *Mathematical Programming A*, vol. 95 (3), pp.573-616.

Moguerza, J.M. y Prieto, F.J. "Combining search directions using gradient flows", *Mathematical Programming A*, vol. 96 (3), pp. 529-559.

Muñoz, A. y Martín-Merino, M. "Visualizing asymmetric proximities with MDS models", *Proceedings of the European Symposium on Artificial Neural Networks*, pp. 51-58.

Muñoz, A., Martín de Diego, I. y Moguerza, J.M. "Support vector machine classifiers for asymmetric proximities", *Lecture Notes on Computer Science*, Springer Verlag, vol. 2714, pp. 217-224.

Muñoz, A. y Moguerza, J.M. "Combining support vector machines and ARTMAP architectures for natural classification", *Lecture Notes on Artificial Intelligence*, Springer Verlag, vol. 2774, pp. 16-21.

Peña, D. y Poncela, P., "Forecasting with nonstationary dynamic factor models", *The Journal of Econometrics*.

Peña, D. y Guerrero, V., "Combining multiple time series predictors: a useful inferential procedure", *Journal of Statistical Planning and Inference*, 116, pp. 249-276.

Peña, D., Rodríguez, J. y Tiao, G.C., "Identifying mixtures of regression equations by the SAR procedure", with discussion, *Bayesian Statistics 7*, Bernardo et al. (eds). Oxford: Oxford University Press, pp. 327-347.

Peña, D., "Comment on Bayesian clustering by L. Liu et al.", *Bayesian Statistics*, 7, Bernardo et al. (eds). Oxford: Oxford University Press, pp. 271-275.

Peña, D. y Rodríguez, J., "Descriptive measures of multivariate scatter and linear dependence", *Journal of Multivariate Analysis*, 58, 2, pp. 361-374.

Peña, D. y Sánchez, M.J., "The identification of multiple outliers in ARIMA models", *Communications in Statistics, Theory and Methods*, 32, 6, pp. 1265-1287.

Pettit, L.I., Wiper, M.P. y Young, K.D.S. "Bayesian inference for some Lanchester combat laws", *European Journal of Operational Research*, vol. 148, pp. 152-165.

Ruiz, E. y Pérez, A. "Asymmetric long memory GARCH: a reply to Hwang's model", *Economics Letters*, vol. 78, pp. 415-422.

Ruiz-Capillas, C., Moral, A. y Villagarcía, T., "Use of semi-trained panel members in the sensory evaluation of hake (*merluccius merluccius*, L) analyzed statistically", *Journal of Food Quality* 26, pp. 181-195.

Sánchez, I., "Efficient tests for unit roots with prediction errors", *Journal of Statistical Planning and Inference*, vol. 113, pp. 341-370.

Tobías, A., Sáez, M., Galán, I., y Campbell, M.J., "Sensitivity analysis of common statistical models used to study the short term effects of air pollution on health", *International Journal of Biometeorology*, vol. 47, pp. 227-229.

Tobías, A., Galán, I. Banega, J.R., y Aranguéz, E., "Short-term effects of airborne pollen concentrations on asthma epidemic", *Thorax*, vol. 58, pp. 708-710.

Tobías, A., Díaz, J., López, C., Linares, C. y miembros del proyecto europeo "Traffic noise pollution: similarities and differences between European regions", "Los riesgos de vivir ruidosamente. Resultados de un estudio europeo", *Revista Interdisciplinar de Gestión Ambiental*, vol. 58, pp. 23-32.

Tobías, A., Galán, I., Banegas, J.R., y Aranguéz, E., "Short-term effects of air pollution on daily asthma emergency room admissions", *European Respiratory Journal*, vol. 22, pp. 802-808.

Tobías, A. y Scotto, M.G. "Interpretando correctamente en salud pública estimaciones puntuales, intervalos de confianza y contrastes de hipótesis", *Salud Pública de México*, vol. 45, pp. 396-401.

Wilson, S. y Costello, M., "Predicting future discoveries of European marine species using a non-homogeneous renewal process", *Applied Statistics*.

Wilson, S. y Wiper, M., "A bayesian analysis of beta testing", *Test*.

Wilson, S., "Predicting orthopaedic hip replacement reliability from damage accumulation data", *Applied Statistics*.

Wilson, S. y Whiley, M., "Parallel algorithms for Markov Chain Monte Carlo methods in latent spatial gaussian models", *Statistics and Computing*.

Libros y colaboraciones

Books

2002

Peña, D., Regresión y Diseño de Experimentos, Alianza Editorial.

Peña, D., Análisis de datos multivariantes, McGraw Hill.

2003

Martín Municio, A., Espasa, A., Girón, J. y Peña, D. El valor económico de la lengua española, Espasa.

Colaboraciones en obras colectivas

Contributions to joint works

2002

Albacete, R. y Espasa, A. "Econometric modelling for short-term inflation forecasting" en Actas del International Symposium of Forecasting 2002, pp. 111.

Ausin, M.C., Lillo, R.E. y Wiper, M.P. "Bayesian modeling of hospital bed occupancy times using a mixed generalized Erlang distribution" en Actas del 7º Valencia International Meeting on Bayesian Statistics.

Durban, M.L., Currie, I. y Eilers, P. "Using P-splines to smooth two-dimensional Poisson data" en Proceedings of the 17th International Workshop on Statistical Modelling, pp. 207-214.

Muñoz, A., Martínez Moguerza, J. y Martín Merino, M. "Detecting the number of clusters using a support vector machine approach" en Lecture Notes in Computer Science, Springer Verlag, pp. 763-768.

Ruiz, E. y Pascual, L., "Bootstrapping financial time series" en Contributions to Financial Econometrics: Theoretical and Practical issues. Edit. Blackwell.

Sánchez, I. "Statistical modelling in society" en Tracking time-varying parameters with the Cook's distance, Stasinopoulos and Toulomi editors, pp. 575-580.

Tobías, A., Bonfill, X. y Subirana, M., "Oncología basada en la evidencia: interpretación práctica de los ensayos clínicos" en Avances en Oncología, Edit. Aran.

2003

Ausín, C., Lillo, R.E. y Wiper, M.P., "General queueing system analysis based on the method of stages" en Actas del Workshop on Bayesian Inference for stochastic processes.

Ausín, C., Lillo, R.E., Ruggeri, F. y Wiper, M.P. "Bayesian modelling of hospital bed occupancy times using a mixed generalized Erlang distribution" en Bayesian Statistics 7, Oxford University Press, pp. 443-451.

Baíllo, A., "Error global en estimación no paramétrica de conjuntos de nivel" en XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, pp. 1546-1550.

Currie, I., Durbán, M. y Eilers, P. "Using P-splines to extrapolate two-dimensional Poisson data" en Proceedings of the 18th International Workshop on Statistical Modelling.

Durbán, M., Wand, M.P., "Simple fitting of subject-specific curves for longitudinal data" en Actas del IX Conferencia Española de Biometría.

Durbán, M., "P-splines para datos de Poisson en dos dimensiones" en Actas del XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa.

Durbán, M. y Sánchez, I., "Predicción de la oferta de energía eólica mediante una combinación adaptativa de modelos dinámicos" en Actas del XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Universitat de Lleida, pp. 1732.

González, I. y Sánchez, I., "Control de la repetibilidad mediante gráficos de control en los procedimientos de inspección técnica de vehículos" en Actas del XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Universitat de Lleida, pp. 4037.

Harvey, A., Ruiz, E. y Shephard, N.G., "Multivariate stochastic variance models" en Recent developments in time series, Edit. Edward Elgar.

Lillo, R.E., Ausín, C., Wiper, M.P., "Métodos bayesianos en problemas de diseño óptimo de sistemas de colas" en Actas del XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa.

Muñoz, A., Martín de Diego, I., Moguerza, J.M. "Support vector machine classifiers for asymmetric proximities" en Artificial Neural Networks and Neural information processing (Proc. Joint Int. Conf. ICANN/ICONIP 2003), Edit. Springer Verlag, pp. 140-148.

Ruiz, E., "Quasi-maximum likelihood estimation of stochastic volatility models" en Recent developments in time series, Edit. Edward Elgar.

Sánchez, I., "Adaptive forecast combination for the efficient prediction of wind energy production" en 2003 European Wind Energy Conference and Exhibition, edit. EWEA, pp. A.T1 formato electrónico.

Sánchez, I., Usaola, J., Martí, I., García, M., Navarro, J., Muñoz, A. y González, G., "Wind power prediction in complex terrain LOCALPRED and SIPREOLICO" en 2003 European Wind Energy Conference and Exhibition, edit. EGEA, pp. BW3.2 formato electrónico,.

Sánchez, I., Usaola, J. y Kariniotakis, G., "ANEMOS: Development of a next generation wind power forecasting system for the large-scale integration on Onshore and Offshore wind farms" en 2003 European Wind Energy Conference and Exhibition, edit. EWEA, pp. AT1 formato electrónico.

Wilson, S., "Modeling hip replacement reliability by damage accumulation" en Mathematical Reliability: an Expository Perspective.

Wilson, S. y Samaniego, F., "Non-parametric methods in software reliability" en Mathematical and Statistical Methods in Reliability.

Documentos de Trabajo

Working Papers

2002

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García Sipols, A., "*Range unit tests*". WP 02-61 (17). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Arrazola, M. y de Hevia, J. "*Estimación de los efectos de un tratamiento: una aplicación a la educación superior en España*", Papeles de Trabajo del IEF, 25/02, Instituto de Estudios Fiscales.

Arrazola, M. y de Hevia, J. "*Sensibilidad de las estimaciones del rendimiento de la educación a la elección de instrumentos y forma funcional*", Papeles de Trabajo del IEF, 26/02, Instituto de Estudios Fiscales.

Ausín, M.C., Lillo, R.E., Ruggeri, F. y Wiper, M.P. "*Bayesian modeling of hospital bed occupancy times using a mixed generalized Erlang distribution*". WP 02-26 (05). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Balbás, A., Romera, R. e Ibáñez, A. "*Shadow risk-free returns when hedging the interest rate risk*". WP 02-05 (01). Serie de Economía de la Empresa. Universidad Carlos III de Madrid.

Broto, C. y Ruiz, E., "*Estimation methods for stochastic volatility models: a survey*". WP 02-54 (14). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Díaz García, José A., González-Farías, G., "*Singular random matrix decompositions: Jacobians*". WP 02-41 (10). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Díaz García, José A., González-Farías, G., "*Singular random matrix decompositions: Distributions*". WP 02-42 (11). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Durbán, M. y Currie, I., "*A note on p-spline additive models with correlated errors*". WP 02-37 (08). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Durbán, M., Currie, I. y Eilers, P., "*Using p-splines to smooth two-dimensional data*". WP 02-38 (09). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Espasa, A., Poncela, P. y Senra, E., "*Forecasting monthly US consumer price indexes through a disaggregated I (2) analysis*". WP 02-03 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Espasa, A., Albacete, R., Mínguez, R. y Senra, E., "*Macroeconomic forecasts for the Euro-zone and some policy implications*". WP 02-36 (07). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Espasa, A., "*Consideraciones econométricas para el análisis de la coyuntura económica*". D.T. 02-12 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J. y Martínez, O., *"Threshold integrated moving average proceses (TIMA)"*. WP 02-44 (12). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Gonzalo, J. y Martínez, O., *"Does size matter? (At least for identification it helps)"*. WP 02-45 (13). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Nielsen, J.P. y Sperlich, S., *"Smooth backfitting in practice"*. WP 02-59 (16). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Rodríguez-Bernal, M.T. y Wiper, M.P., *"Bayesian inference for fault based software reliability models given software metrics data"*. WP 02-04 (02). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Romera, R., Valdés, J. y Zequeira, R., *"Active redundancy allocation in systems"*. WP 02-06 (03). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sánchez, I., *"Recursive estimation of dynamic models using cook's distance, with application to wind energy forecast"*. WP 02-55 (15). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sánchez-Mangas, R., *"Another look at the estimation of dynamic programming models with censored decision variables"*. WP 02-24 (04). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sánchez-Mangas, R., *"Pseudo-maximum likelihood estimation of a dynamic structural investment model"*. WP 02-62 (18). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Velilla, S. y Hernández, A., *"On the consistency and robustness properties of linear discriminant analysis"*. WP 02-35 (06). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

2003

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García Sipols, A., *"Range unit-root tests"*. WP 03-11 (02). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Baíllo, A., *"Total error in a plug-in estimator of level sets"*. WP 03-28 (06). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Balbas, A., Romera, R. y Ruiz, E., *"An overview of probabilistic and time series models in finance"*. WP 03-24 (05). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Broto, C., Ruiz, E., *"Unobserved component models with asymmetric conditional variances"*. WP 03-20 (03). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E., *"Detecting level shifts in the presence of conditional heteroscedasticity"*. WP 03-63 (13). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Cuadro-Sáez, L., Peña, I. y Romo, J.J., *"Detecting abnormal market behavior using resampling techniques"*. WP 03-13 (03). Serie de Economía de la Empresa. Universidad Carlos III de Madrid.

Flachaire, E. y Núñez, O., *"Estimation of income distribution and detection of subpopulations: an explanatory model"*. WP 03-02 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Guttman, I., Peña, D., Redondas, M.D., *"A bayesian approach for predicting with polynomial regresión of unknown degree"*. WP 03-21 (04). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Marín, J.M., Rodríguez, M.T., Wiper, M., *"Using weibull mixture distributions to model heterogeneous survival data"*. WP 03-32 (08). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Ubierna, A., y Velilla, S., *"Comportamiento asintótico del correlograma residual"*. DT 03-01 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Wiper, M., Wilson, S., *"A bayesian analysis of beta testing"*. WP 03-31 (07). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

VII. CONGRESOS, CONFERENCIAS Y SEMINARIOS.

VII. MEETINGS AND CONFERENCES ATTENDED

Presentaciones en congresos

Meetings

2002

Arrazola, M. y de Hevia, J. "Returns to education in Spain: new evidence on the differences between men and women", **XXVII Simposio de Análisis Económico**, Salamanca (España).

Arrazola, M. y de Hevia, J. "Returns to education in Spain: new evidence on the differences between men and women", **V Jornadas de Economía Laboral**, Reus (España).

Baillo, A. "Total error in a plug-in estimator of density level sets", **Stochastic Inequalities and their applications**, Barcelona (España).

Conejo, A.J., Arroyo, J.M. y Nogales, F.J. "Bidding strategy under price uncertainty", **INFORMS Annual Meeting**, San Jose (USA).

Conejo, A.J., Contreras, J. y Nogales, F.J., "Day-ahead price forecasting methods in electricity markets", **INFORMS Annual Meeting**, San Jose (USA).

Dolado, J.J., Gonzalo, J. y Mayoral, L. "The role of deterministic components in the Fractional Dickey-Fuller test for unit roots", **European Meeting of the Econometric Society**, Venecia (Italia).

Espasa, A. y Albacete, R. "Econometric modelling for short-term inflation forecasting", **The 22nd International Symposium on Forecasting**, Dublin (Irlanda).

Espasa, A., Poncela, P. y Senra, E. "Forecasting monthly US consumer price indexes through a disaggregated I(2)", **Analysis European Meeting of the Econometric Society**, Venecia (Italia).

López, S. y Romo, J.J. "On the concept of depth for functional data", **Joint Statistical Meetings**, Nueva York (EE.UU.).

Miguel, A.V. de, Nogales, F.J., "An interior-point decomposition algorithm using low-cost subproblem solutions", **INFORMS Annual Meeting**, San Jose (USA).

Martín-Merino, M. y Muñoz, A., "A new asymmetric topographic mapping algorithm", **Knowledge-based intelligent Information Engineering Systems**, Crema (Italia).

Muñoz, A., Martínez-Moguerza, J. y Martín Merino, M. "Detecting the number of clusters using a support vector machine approach", **International Conference on Artificial Neural Networks**, Madrid (España).

Muñoz, A. y Martín-Merino, M., "A new SOM algorithm that visualizes topic hierarchies", **6th. World Multiconference on Systemics, Cybernetics and Informatics**, Florida (EE.UU.)

Peña, D., Rodríguez, J. y Tiao, C.G., "The SAR procedure for mixing regressions", **VII International Meeting on Bayesian Statistics** (invited speaker), Tenerife (España).

Peña, D. y Poncela, P., "Latent variables models for vector time series", **Colloquium in honour of Prof. Durbin**, Amsterdam (Países Bajos).

Peña, D. y Rodríguez, J., "A new powerful test of goodness of fit for time series", **CLAPEN**, La Habana (Cuba).

Prieto, F.J. y Moguerza, J.M. "Combining search directions to ensure convergence to second-order points of inequality constrained problems", **SIAM Conference on Optimization**, Toronto (Canadá).

Romera, M.R., "Limiting discounted-cost control of partially observable stochastic systems", **41st. IEEE Conference on Decision and Control**, Las Vegas, Nevada, (EE.UU).

Romo, J.J., Ruiz, E. y Pascual, L. "Bootstrap prediction intervals for GARCH models", **International Symposium of Forecasting**, Dublín (Irlanda).

Ruiz, E. y Pérez, A. "Properties of autocorrelations in stochastic volatility models", **Australian Meeting of the Econometric Society**, Brisbane (Australia).

Velilla, S. Discussion on "An adaptative estimation of dimension reduction space" by Xia, Y., Tong, H., Li, W.K. y Zhu, L-X, **Ordinary Meeting of the Royal Statistical Society**.

Velilla, S. y Hernández, A. "Dimension reduction in Kernel discriminant analysis", **162th Annual Meeting of the American Statistical Association**, New York (EE.UU.).

2003

Ausín, C., Lillo, R.E. y Wiper, M.P. "Métodos bayesianos en problemas de diseño óptimo en colas", **XXVII Congreso de la SEIO**, Lleida (España).

Baíllo, A., "Using density level sets for nonparametric control charts", **Deuxièmes Journées de Statistique Fonctionnelle et Opératoirelle**, Toulouse (Francia).

Barrios, P. y Velilla, S., "Determinación de la dimensión estructural de un problema de regresión basada en el método SIR", **XXVII Congreso de la SEIO**, Lérida (España).

Barrios, P. y Velilla, S., "Bootstrapping SIR for dimension assessment in regression", **163th Annual Meeting of the American Statistical Association**, San Francisco (USA).

Cancelo, J.R. y Espasa, A., "Forecasting regional economic activity when the reference series are short: a case study", **International Symposium of Forecasting**, Mérida (México).

Durbán, M., "Smoothing methods for mortality data", **Laboratory of Survival and Longevity**, Rostock (Alemania).

Espasa, A., y Minguez, R., "A time series disaggregated model to forecast GDP in the euro-zone", **International Symposium of Forecasting**, Mérida (México).

Miguel, A.V. de, Friedlander, M.P., Nogales, F.J. y Scholtes, S., "An interior-point method for MPECs", **International Symposium on Mathematical Programming**, Copenhagen (Dinamarca).

Muñoz, A. y Martín-Merino, M., "Visualizing asymmetric proximities with MDS models", **European Symposium on Artificial Neural Networks**, Brujas (Bélgica).

Muñoz, A., Martín de Diego, I. y Moguerza, J.M. "Support vector machine classifiers for asymmetric proximities", **International Conference on Artificial Neural Networks**, Estambul (Turquía).

Muñoz, A. y Moguerza, J.M. "Combining support vector machines and ARTMAP architectures for natural classification", **Knowledge-based Intelligent Information Engineering Systems**, Oxford (Inglaterra).

Niño-Mora, J. "Dynamic allocation indices for restless projects and queueing admission control: a polyhedral approach", **18th International Symposium on Mathematical Programming**, Copenhague (Dinamarca).

Nogales, F.J. y Miguel, A.V. de, "Un algoritmo de descomposición de punto interior usando soluciones inexactas en los subproblemas", **XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa**, Lleida (España).

Peña, D. y Sánchez, I., "Multifold cross-validation in ARMAX time series models", **2003 NBER/NSF Time Series Conference**, Chicago (EE.UU).

Peña, D., "Model selection in Time series" **Time series conference**, Universidad Federico II de Nápoles (Italia).

Pérez, A. y Ruiz, E., "Properties of autocorrelations of non-linear transformations in long memory stochastic volatility models", **International Symposium of Forecasting**, Mérida (Méjico).

Romo, J. y López, S., "Exploring depth for functional data", **Tallahassee**, Florida (EE.UU.)

Romo, J. y López, S. "Estadísticos de orden para datos funcionales", **XXVII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa**, Lleida (España).

Romo, J. y López, S. "A new definition of depth for functional data", **DIMACS**, Rutgers University, New Jersey (EE.UU.).

Romo, J. y López, S., "A functional depth analysis for environmental data", **ISI**, Santiago de Compostela (España).

Romo, J., "Depth based inference for functional observations", **ASA and IMS Joint Statistical Meetings**, San Francisco (EE.UU).

Tobías, A., Sáez, M. y Campbell, M.J. "Time-series regression models used in the study of the short-term effects of air pollution on health", **The ISI International Conference on Environmental Statistics and Health**, Santiago de Compostela (España).

Tobías, A., Galán, I. "Short-term effects of air pollution and pollen on asthma emergency room visits for asthma in Madrid: a case cross-over analysis", **Meeting of the European Federation of the International Epidemiological Association**, Toledo (España).

Tobías, A., Galán, I., Prieto, A., Rubio, M., Zorrilla, B., Gandarillas, A., Cantero, J.L., Cuadrado, I., "Association between pollen and epidemic asthma in Madrid", **Meeting of the European Federation of the International Epidemiological Association**, Toledo (España).

Wiper, M.P. y Wilson, S. "Comprobación de software. Un análisis bayesiano", **XXVII Congreso de la SEIO**, Lérida (España).

Wiper, M.P. y Wilson, S. "A bayesian analysis of beta testing", **Euro-Infirms Congress**, Estambul (Turquía).

Wiper, M.P., Ausín, M.C. y Lillo, R.E. "Bayesian inference and prediction for the GI/M/c queueing system with applications to optimal design problems", **Euro-Infirms Congress**, Estambul (Turquía).

Conferencias y seminarios impartidos

Conferences and seminars

2002

Arrazola, M.J.; Hevia, J.d. "Problemas en la estimación del rendimiento de la educación", *Seminario de Economía Pública, Instituto de Estudios Fiscales, Madrid (España)*.

Carnero, M.A. Peña, D.; Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Seminario del CEMFI, Madrid (España)*.

Carnero, M.A. Peña, D.; Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Seminario del Departamento de Economía de la Universidad Complutense, Madrid (España)*.

Carnero, M.A. Peña, D.; Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Seminario del Departamento de Economía de Singapore Management University, Singapur*.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E. "Why is GARCH more persistent and conditionally leptokurtic than stochastic volatility?", *Seminario en la Universidad Politécnica de Cataluña, Barcelona (España)*.

Espasa, A. "Metodología moderna para el análisis de la coyuntura económica", *Ciclo "Seminari de Finances de Barcelona, Barcelona (España)*.

Espasa, A., "Problems of aggregation in inflation forecasting", *Workshop on Problems in Economic Forecasting, Nuffield College, Oxford (Reino Unido)*.

Lillo, R.E. "Comportamiento límite en modelos de colas", *Seminario en la Universidad de Murcia, Murcia (España)*.

Romera, M.R., "Resultados avanzados en control estocástico", *Seminario en el Departamento de Matemáticas del CINVESTAV-Instituto Politécnico Nacional (México)*.

Romera, M.R., "Búsqueda de equilibrios en problemas avanzados de control estocástico", *Seminario en el Departamento de Estadística del ITAM (México)*.

Romo, J.J. "El bootstrap y sus aplicaciones", *Seminario del Departamento de Estadística. Universidad Pública de Navarra, Pamplona (España)*.

Romo, J.J., Ruiz, E. y Pascual, L. "Bootstrap prediction intervals for GARCH models", *Seminario del Departamento de Economía de la University of Canterbury, Christchurch (Nueva Zelanda)*.

Romo, J.J., Ruiz, E. y Pascual, L. "Bootstrap prediction intervals for GARCH models", *Seminario del Departamento de Economía de la University of New South Wales, Sidney (Australia)*

2003

Arrazola, M. y de Hevia, J. "Estimación de los efectos de un tratamiento: una aplicación a la educación superior en España", *Seminario en el Dpto. de Organización de Empresas de la Universidad Pública de Navarra, Pamplona (España)*.

Baíllo, A., "Use of laguerre polynomials in estimating the number of species", *Seminario en School of Mathematical and Computing Sciences, Victoria University of Wellington (Nueva Zelanda)*.

Broto, C. y Ruiz, E. "Unobserved components models with asymmetric ARCH disturbances: an application to inflation", *Seminario en el Timbergen Institute, Ámsterdam (Holanda)*.

Durbán M., "P-splines for longitudinal data", *Seminario en el Dept. Economics de Bielefeld University, Bielefeld (Alemania)*.

Espasa, A., "Forecasting inflation in the EMU", *European Central Bank, Frankfurt (Alemania)*.

Espasa, A., "Prediction and seasonal adjustment in the Prof. G. Tiao's research", *Workshop in Time Series in honour of Prof. G.C. Tiao, Madrid (España)*.

Kaiser, R. "Seasonal adjustment and short-term monitoring with Tramo-Seats", *Seminario del Departamento de Economía Aplicada II, Universidad del País Vasco, Bilbao (España)*.

Núñez, O., "Evolution of the cross-country income distribution: a mixture autoregressive model approach", *Seminario en el Departamento de Economía de Vigo (España)*.

Peña, D., "Heterogeneity in regression models", *Université de Aix-Marseille, GREQAM (Francia)*.

Peña, D. y Tiao, C.G., "The SAR Procedure", *Lancaster University (Reino Unido)*.

Peña, D. y Rodríguez, J., "Finding groups in multivariate data", *Universidad de Dortmund (Alemania)*.

Peña, D. y Rodríguez, J., "New procedures for cluster analysis", *Universidad Federico II de Nápoles (Italia)*.

Peña, D., Rodríguez, J. y Tiao, C.G., "New approaches for detecting heterogeneity: the SAR procedure", *Universidad de Roma La Sapienza (Italia)*.

Peña, D. "A Model based cluster methods", *Universidad Técnica de Lisboa (Portugal)*.

Tobías, A., "Fundamentos estadísticos para la visión analítica del metaanálisis", *Conferencia clínica del Hospital Clínico y Provincial de Barcelona, Barcelona (España)*.

Tobías, A., "Fundamentos estadísticos para la visión analítica del metaanálisis", *Seminario del Instituto Nacional de Salud Pública, Cuernavaca (México)*.

Tobías, A., "La importancia del metaanálisis en la medicina clínica actual", *Conferencia clínica Hospital General Dr. Manuel Gea González, México D.F. (México)*.

Velilla, S., "Bootstrapping SIR for dimension assessment in a general regression problem", *Statistics Seminar, School of Mathematical Sciences, University of Exeter, Exeter (Reino Unido)*.

Estancias en otros centros

Visits to other Departments

2002

Durban, M.

“P-splines for Poisson data” en Dept. Actuarial Mathematics and Statistics, Heriot-Watt University (Reino Unido). *Duración:* 14/5/2002 a 19/5/2002.

“Semiparametric models and P-splines” en Dpto. Bioestadística, Universidad de Harvard (EE.UU.). *Duración:* 6/9/2002 a 26/10/2002.

Romera, M.R.

“Control estocástico” en el Departamento de Matemáticas del CINVESTAV-Instituto Politécnico Nacional (México). *Duración:* diciembre 2002.

Tobías, A.M.

“Modelos estadísticos para el análisis de los efectos a corto plazo del polen sobre las urgencias hospitalarias por asma”, Universitat de Girona (Dpto. Economía, Grup de Recerca en Estadística, Economía Aplicada i Salut). *Duración:* 6/5/2002 a 12/5/2002.

2003

Baíllo, A.

“The modern change-set problem and the concept of local covering numbers (local metric entropy)” en el School of Mathematical and Computing Sciences, Victoria University of Wellington (Nueva Zelanda) y financiado por las Ayudas a Jóvenes Doctores de la Universidad Carlos III de Madrid. *Duración:* 1/3/03 a 31/5/03.

Niño-Mora, J.

Reunión para la preparación de la propuesta de Red de Excelencia “Euro-NGI” del VI Programa Marco de la Unión Europea. Escuela Nacional Superior de Telecomunicaciones, París. *Duración:* 10-13 abril de 2003.

Nogales, F.J.

“Mathematical programs with equilibrium constraints” financiado por las Ayudas para la movilidad de jóvenes doctores. London Business School, Reino Unido. *Duración:* 1/7/03 a 31/8/03.

Núñez, O.

“Colaboración en la elaboración de un artículo sobre la modelización de la evaluación de la distribución de la renta entre países” junto a Emmanuel Flachaire en MSE (Maison des Sciences Economiques), Paris Sorbonne, Paris (Francia). Financiado por Proyecto “Metodología Econométrica para la modelización y predicción de series macroeconómicas y financieras” cuyo investigador principal es Antoni Espasa. *Duración: junio 2003.*

Tobías, A.

“Modelos estadísticos para el análisis de los efectos a corto plazo de la contaminación atmosférica sobre las urgencias hospitalarias por asma en la ciudad de Madrid” financiado por la Universidad Autónoma de Madrid en el Grup de Recerca en Estadística, Economia Aplicada i Salut (GRECS), Departamento de Economía de la Universitat de Girona con Marc Saez Zafra. *Duración: abril 2003 a septiembre de 2003.*

Wilson, S.

“Un curso de introducción a probabilidad e investigaciones con el Prof. Samaniego de la Universidad de California, Davis”. EE.UU. *Duración: julio 2003- agosto 2003.*

**VIII. SEMINARIOS IMPARTIDOS EN
EL DEPARTAMENTO**

VIII. DEPARTMENT SEMINARS

2002

MICHAEL NEUMANN (University of Cologne). *"Testing the transition mechanism of time series models"*. 11 de enero de 2002.

M^a ÁNGELES PULIDO (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de tesis: "Técnicas de clasificación con datos continuos"* 18 de enero de 2002.

MÓNICA BENITO BONITO (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de tesis: "Métodos estadísticos para el tratamiento de imágenes"*. 18 de enero de 2002.

JUAN CARLOS ESCANCIANO (Universidad Carlos III de Madrid) *Propuesta de tesis: "Contrastes de hipótesis consistentes para series temporales univariantes"*. 18 de enero de 2002.

MICHAEL MCALEER (University of Western Australia). *"Estimating smooth transition autoregressive models with GARCH errors in the presence of extreme observations and outliers"*. 23 de enero de 2002.

AURORA TORRENTE (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de tesis: "Técnicas de remuestreo en clasificación genética"* 25 de enero de 2002.

ISAAC MARTÍN DE DIEGO (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de tesis: "Estudio estadístico de las máquinas de vector soporte, con aplicación a problemas de regresión y clasificación en alta dimensión"* 25 de enero de 2002.

LAURIE DAVIES. (University of Essen). *"The cost of joint nonparametric observation of several samples"*. 8 de febrero de 2002.

WINFRIED STUTE (Giessen University). *"Statistical Analysis of ARCH-M time series"*. 15 de febrero de 2002.

KARIM ABADIR (York University). *"Aggregation, persistence and volatility in a mocomodel"*. 22 de febrero de 2002.

JAMES DAVIDSON (Cardiff University). *"Moment and memory properties of linear conditional heteroskedasticity models"* 1 de marzo de 2002.

RICARDO MARONNA.(Universidad Mar de Plata. Argentina) *"Estimación robusta de posición y dispersión para datos en alta dimensión"*. 6 de marzo de 2002.

SYLVIE HUET. (INRA. Jouy en Josas, Francia). *"Model selection for estimating the non zero coefficients in a Gaussian model"*. 8 de marzo de 2002.

FELISA J. VÁZQUEZ-ABAD (University of Melbourne). *"Simulación inteligente, aplicaciones en finanzas y telecomunicaciones"*. 22 de marzo de 2002.

YURI GOLUBEV (Université de Provence, Francia). *"How to improve density estimation in SPLUS"*. 5 de abril de 2002.

EMMA IGLESIAS (Cardiff University, U.K.). *Seminario de contratación. "Finite sample behaviour of the ML estimator in univariate and multivariate ARCH models"*. 10 de abril de 2002.

JULIO RODRÍGUEZ PUERTA (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de Tesis: "Contribuciones al estudio de la heterogeneidad y la dependencia"* 11 de abril de 2002.

JOSÉ GARRIDO (Concordia University, Montreal –Canadá-) *"Robust Logistic regresión for insurance risk classification"*. 12 de abril de 2002.

JAVIER NOGALES (Universidad de Castilla la Mancha). *Seminario de contratación: "Propiedades de convergencia local en un algoritmo de descomposición basado en punto interior"*. 15 de abril de 2002.

SIMON WILSON (Trinity College, Dublín). *Seminario de contratación. "Parallel algorithms for MCMC with application to spatial gaussian models for paleoclimatological data"*. 16 de abril de 2002.

MARÍA TERESA RODRÍGUEZ BERNAL (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de Contratación. "Inferencia bayesiana para unos modelos de fiabilidad de software utilizando métricas"*. 17 de abril de 2002.

SIEM KOOPMAN (Free University, Ámsterdam –Holanda-). *"Maximum likelihood estimation of state space models with common stochastic variance components"*. 19 de abril de 2002.

MICHAEL LECHNER (ST. Gallen University). *"Labour economics and Econometrics"*. 10 de mayo de 2002.

KOSTAS POLITIS (University of Southampton). *"Approximations for the probability of ruin in insurance risk"*. 17 de mayo de 2002.

NUNO CRATO (ISEG, Lisboa). *"Measuring a tail when we don't see its tip (Estimating parameters of censored stable distributions)"*. 31 de mayo de 2002.

MARIO IZQUIERDO (Banco de España). *"Car quality improvements and price indices in Spain"*. 7 de junio de 2002.

GEORGE CASELLA (University of Florida/Universidad de Granada). *"Objective bayesian variable selection"*. 10 de octubre de 2002.

JACINTO GONZALES PACHON (Universidad Politécnica de Madrid). *"Inconsistencias: un problema de consenso entre realidad y modelo"*. 18 de octubre de 2002.

NATALIE NEUMAYER (Ruhr University, Alemania). *"Testing the equality of nonparametric regresión functions"*. 25 de octubre de 2002.

ANTONIO ARTES RODRÍGUEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *"Máquinas de vectores soporte para estadística variante"*. 8 de noviembre de 2002.

M^a ANGELES CARNERO (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de tesis: "Heterocedasticidad condicional, atípicos y cambios de nivel en series temporales financieras"*. 14 de noviembre de 2002.

CHARLES BOS (Vrije University, Amsteden). *"A comparison of marginal likelihood computation methods"*. 15 de noviembre de 2002.

ROCÍO SÁNCHEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de tesis: "Estimación estructural de modelos dinámicos de decisión. Aplicación a decisiones de inversión bajo irreversibilidad"*. 18 de noviembre de 2002.

TOMAS ALUJA (Universitat Politecnic de Catalunya). *"Data fusion methods"*. 22 de noviembre de 2002.

MATT WHILEY (Trinity College, Dublín). *"Predicting past climates using fossil records"*. 29 de noviembre de 2002.

FABRICIO RUGGERI (CNR-IMATI, Milán, Italia). *"On the reliability of repairable systems: methods and applications"*. 10 de diciembre de 2002.

ALFONSO SUÁREZ LLORENS (Universidad de Cádiz). *"Dispersión multivariante a través del concepto de ensanchamiento de cuantiles"*. 13 de diciembre de 2002.

RON BEWLEY (Commonwealth Bank of Australia). *"Modelling risk in equity markets"*. 17 de diciembre de 2002.

2003

JUAN CARLOS IBÁÑEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de propuesta de tesis: "Reducción de dimensión en series temporales múltiples mediante redes neuronales artificiales"*. 24 de enero de 2003.

JEAN PIERRE NONO (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de propuesta de tesis: "Variance components testing in non-linear random effects models"*. 24 de enero de 2003.

MATHIEU KESSLER (Universidad Politécnica de Cartagena). *"Estimación paramétrica para ecuaciones diferenciales estocásticas"*. 14 de febrero de 2003.

ANDRÉS UBIERNA (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de tesis: "Métodos de bondad de ajuste en series temporales basados en el correlograma residual"*. 17 de febrero de 2003.

GEORGE TIAO (University of Chicago). *"Effect of kurtosis and volatility clustering on variance estimation"*. 19 de febrero de 2003.

ANINDYA BANERJEE (European University Institute). *"Some difficulties with the use of panel methods for integrated series"*. 28 de febrero de 2003.

ANGELIKA VAN DER LINDE (University of Bremen). *"On the complexity of statistical models"*. 14 de marzo de 2003.

JOHN T. KENT (University of Leeds). *"Fun and games with the EM algorithm"*. 21 de marzo de 2003.

FRANCISCO JOSÉ VÁZQUEZ POLO (Universidad de Las Palmas de Gran Canaria). *"Herramientas bayesianas robustas para la asignación de primas bonus-malus en la estadística actuarial"*. 28 de marzo de 2003.

TIMO TERASVIRTA (Stockholm School of Economics). *"A time series model for an exchange rate in a target zone with applications"*. 4 de abril de 2003.

MARÍA ALBAREDA (Universidad Politécnica de Cataluña). Seminario de contratación: *“Generación de columnas para un problema combinado de localización y rutas”*. 23 de abril de 2003.

FRANCISCO BALLESTÍN (Universidad de Valencia). Seminario de contratación: *“Nuevos métodos en la secuenciación de proyectos con recursos limitados”*. 24 de abril de 2003.

SIMON WILSON (Universidad Carlos III de Madrid). *“Bayesian nonparametric software reliability modeling”*. 25 de abril de 2003.

ROLAND FRIED (University of Dortmund). Seminario de contratación: *“Dimension reduction and pattern recognition for multivariate time series”*. 28 de abril de 2003.

ISABEL MOLINA (Universidad Miguel Hernández). Seminario de contratación: *“Contraste de hipótesis compuestas con divergencias de Rényi”*. 5 de mayo de 2003.

SANTOS FAUNDEZ SEKIRKIN (University College of Dublín). Seminario de contratación: *“Correspondence analysis in the software quality assurance process”*. 5 de mayo de 2003.

ELISENDA MOLINA (Universidad Miguel Hernández). Seminario de contratación: *“ORGames: investigación operativa y juegos cooperativos”*. 6 de mayo de 2003.

JOSÉ ELÍAS RODRÍGUEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *“Muestreo espacial: predicción y diseños de muestreo”*. 9 de mayo de 2003.

HENRI CAUSSINUS (Université Paul Sabatier de Toulouse). *“A monitoring display of multivariate outliers (and other interesting features)”*. 23 de mayo de 2003.

ROGER KOENKER (University of Illinois) *“Total variation regulation, additive models and quantile smoothing”*. 30 de mayo de 2003.

CONCEPCIÓN VALDÉS (Universidad de La Habana). *“Kolmogorov y la ciencia del azar”*. 6 de junio de 2003.