

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
- 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
- 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

2001-2002

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

Arrazola, M. Investigadora principal del proyecto "Rendimiento de la educación y depreciación del capital humano: el caso de las mujeres españolas". Participante: de Hevia, J. Financiado por el Instituto de Estudios Fiscales (IEF). Año de inicio: 2001. Año de finalización: 2001. En este proyecto se estudia el proceso de acumulación y depreciación del capital humano de las mujeres españolas.

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

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, bilingüe en castellano e inglés, pone especial énfasis en realizar un diagnóstico sobre las perspectivas

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 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.

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.

Arrazola, M. Principal researcher of the project "Returns to Education and Human Capital Depreciation: the Case of the Spanish Women". Participants: de Hevia, J. Research project funded by IEF. Beginning: 2001. End: 2001. This project studies the human capital accumulation and depreciation for the case of the Spanish women.

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

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

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.

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 de inicio: 1999. Año fin: 2002. Con la constitución de la Unión Monetaria europea, la implementación 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 en el proyecto "Inflación y competitividad en la Comunidad Autónoma de Madrid". Año inicio: 2000. Año fin: 2002. Participantes: Albacete, R., Lamadriz, A.

implicaciones on monetary and general economic policies.

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

Espasa, A. Principal researcher of DGE "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. 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. In fact, the ECB carries a survey asking for predictions on these variables among professional forecasters, and this research team participates in the survey. This project develops specific country models for each of these variables. Area predictions are built by aggregating national predictions. Augmented autoregressive models through countries 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.

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

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.

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.

Lillo, R. Participante en el proyecto de investigación nacional dirigido por la Universidad Politécnica y Complutense 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.

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

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.

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.

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.

diferencia de los valores medios de la disminución en la PAD o PAS en el grupo

tratado con la asociación respecto al grupo 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.

Martínez, J. Coinvestigador del proyecto "Proyecciones climáticas regionales e impactos del cambio climático en Colombia" financiado por el Instituto Colombiano de Ciencia y Tecnología (COLCIENCIAS) y la Universidad Nacional de Colombia.

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

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., 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 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

Martínez, J. Participant in the project "Regional Climatic projections and impacts of climatic change in Colombia", financially supported by Colombian Institute of Science and Technology (COLCIENCIAS) and Colombian National University.

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

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., 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.

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. Investigadora 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: 2001. Financiado por la Universidad Carlos III de Madrid.

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

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

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

Romera, R. Investigator 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.

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

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

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.

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 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.

Villagarcía, T. Investigador principal del proyecto "Sistema de medición de la satisfacción de los clientes". Año: 2001.

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 "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 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.

Villagarcía, T. Principal research of the project "Sistema de medición de la satisfacción de los clientes". 2001.

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

V.

PH.D.

THESES

2001

Alonso, A. “*Técnicas de remuestreo y datos omitidos en series temporales*” Directores: Peña, D. y Romo, J. Universidad Carlos III de Madrid.

Barrios, M^a Pilar, “*Contrastes de dimensión de tipo bootstrap en problemas generales de regresión*”. Director: Velilla, S. Universidad Carlos III de Madrid.

Pascual, L. “*Predicción bootstrap en series temporales*”. Directores: Romo, J. y Ruiz, E. Universidad Carlos III de Madrid.

Revuelta, J.M. “*Desarrollo de una metodología automática de modelización de series diarias de actividad económica. Aplicación a series diarias de demanda eléctrica*”. Director: Antoni Espasa. Universidad Carlos III de Madrid.

2002

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

VI. PUBLICACIONES Y DOCUMENTOS DE TRABAJO

VI. PUBLICATIONS AND WORKING PAPERS

Publicaciones

Publications

2001

Aguirregabiria, V. y Alonso-Borrego, C. "Occupational structure, technological innovation and reorganization of production", *Labour Economics*, vol. 8 nº 1, pp.43-73.

Aparicio, F.M. y Cossin, D., "Control of credit risk collateralization using quasi-variational inequalities", *Journal of Computational Finance*, pp.5-38.

Arranz, M.A. y Mármol, F. "Out-of-sample forecast errors in misspecified perturbed long memory proceses", *Statistical Papers*, vol. 42, pp. 423-436.

Baillo, A.; Cuevas, A. "On the estimation of a star-shaped set", *Advances in Applied Probability (SGSA)*, Vol. 33, pp. 717-726.

Baílo, A., Cuesta-Albertos, J.A. y Cuevas, A. "Convergence rates in nonparametric estimation of level sets", *Statistics and Probability Letters*, vol. 53, nº 1, pp. 27-35.

Belzunce, F., Lillo, R.E., Ruiz, J.M. y Shaked, M. "Stochastic comparisions of nonhomogeneous processes", *Probability in Engineering and Informational Sciences*, Vol. 15, pp. 199-224.

Cancelo, J.R. y Espasa, A. "Using high-frequency data and time series models to improve yield management", *Inst. J. Services Technology and Management*, v. 2, nos. ½, pp. 59-70.

Carnero, M.d.; Peña, D.; Ruiz, E. "Outliers and conditional autorregressive heteroscedasticity in time series", *Estadística: Journal of the Interamerican Statistical Institute*, Vol. 53, pp. 142-213.

Conejo, A.J. y Prieto, F.J. "Mathematical Programming and Electricity Markets", *Top* 9, 1, pp. 1-21.

Delgado, M.A., Rodríguez-Poo, J. y Wolf, M. "Subsampling cube root asymptotics with an application to Manski's MSE", *Economics Letters*, vol. 73, pp. 241-250.

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regression based on the bootstrap", *Annals of Statistics*, vol. 29, nº 5, pp. 1469-1507.

Durbán, M., Curie, I.D. y Kempton, R.A. "Adjusting for fertility and competition in variety trials", *Journal of Agricultural Sciences*, Vol. 109, pp. 187-201.

Durbán, M. y Glasbey, C.A. "Weather modelling using a multivariate latent Gaussian model", *Agricultural and forest meteorology*, Vol. 136, pp. 129-140.

Gonzalo, J. y Serena Ng. "A systematic framework for analyzing the dynamic effects of permanent and transitory shocks", *Journal of Economic Dynamics & Control*, vol. 25, pp. 1527-1546.

Härdle, W., Sperlich, S. y Spokoiny, V. "Adaptive tests in additive regression", *Revista de Estadística, Statistical Review*, Vol. II, pp. 185-186.

- Hernández-Lerma, O., Romera, R., "Limiting discounted-cost control of partially observable stochastic systems", *SIAM, Journal on Control and Optimization*, 40, pp. 348-369.
- Juan, J. y Prieto, F.J. "Using angles to identify concentrated multivariate outliers", *Technometrics* 43, 3, pp. 311-322.
- Lillo, R.E. y Martín, M. "Stability in queues with impatient customers", *Stochastic Models*, Vol. 17, pp. 375-389.
- Lillo, R.E. "Optimal control of an M/G/1 queue with impatient priority customers", *Naval Research Logistics*, Vol. 48, pp. 200-209.
- Lillo, R.E., Nanda, A. y Shaked, M. "Preservation of some stochastic orders by order statistics", *Statistics & Probability Letters*, VI. 51, pp. 111-119.
- Lillo, R.E.; Martín, M. "Characterizations involving conditional expectations based on a functional derivative approach", *Combinatorics, Probability and Computing*, Vol. 10, pp. 417-434.
- Lillo, R.E.; Martín, M. "Stability condition for a general single server retrial queue", *Advances in Performance Analysis*, Vol. 3, pp. 137-151.
- Pascual, L., Romo, J. y Ruiz, E. "Effects of parameter estimation on prediction densities: a bootstrap approach", *International Journal of Forecasting*, Vol. 17, pp. 83-103.
- Peña, D. y Prieto, F.J. "Multivariate outlier detection and robust covariance matrix estimation", *Technometrics* 43, 3, pp. 286-300.
- Peña, D. y Justel, A. "Bayesian unmasking in linear models", *Computational Statistics and Data Analysis*, 36, pp. 69-84.
- Peña, D. y Prieto, F.J. Reply to the discussion of Robust Covariance matrix estimation and multivariate outlier detection", *Technometrics*, 3, pp. 306-310.
- Peña, D. "An interview with George E.P. Box", *International Journal of Forecasting*, 17, pp. 1-9.
- Peña, D., Justel, A. y Tsay, R. "Detection of outlier patches in autoregressive time series", *Statistica Sinica*, 11, 3, pp. 651-673.
- Peña, D. "An interview to Daniel Peña", *International Society for Bayesian Analysis Bulletin*, Vol. 8, 4, pp. 6-9.
- Peña, D.; Prieto, F.J. "Robust covariance matrix estimation and multivariate outlier detection", *Technometrics*, Vol. 3, pp. 286-310.
- Peña, D.; Prieto, F.J. "Cluster Identification using Projections", *The Journal of American Statistical Association*, Vol. 96, 456, pp. 1433-1445.
- Peña, D.; Sánchez, I. "Properties of predictors in overdifferenced nearly nonstationary autoregression", *Journal of Time Series Analysis*, Vol. 22, pp. 45-66.
- Pérez, A. y Ruiz, E. "Finite sample properties of a QML estimator of stochastic volatility models with long memory", *Economics Letters*, Vol. 70, pp. 157-164.

Rodríguez-Poo, J, Sperlich, S. y Vieu, Ph. "Normalité asymptotique d'estimateurs de maximum de vraisemblance pour modèles nonparamétriques de regresión multidimensionnelle", *C.R. Acad. Sci. Paris*, Vol. 333 I, pp. 61-64.

Romera, M.R.; Hernández-Lerma, O. "Limiting discounted-cost control of partially observable stochastic systems", *SIAM J. Control Optim.*, Vol. 40, nº 2, pp. 348-369.

Sánchez, I. y Peña, D. "Properties of predictors in overdifferenced nearly nonstationary autoregression", *Journal of Time Series Analysis*, vol. 22, pp. 45-46.

Tobías, A.M.; Galán, I.; Aránguez, E.; Aragonés, N.; Bleda, J. "Contaminación atmosférica de tipo fotoquímico, polen y demanda por asma en urgencias hospitalarias en el municipio de Madrid", *Gaceta Sanitaria*, Vol. 15 (supl. 2), pp. 31.

Tobías, A.M.; Galán, I.; Aránguez, E.; Bleda, J.; Aragonés, N. "Contaminación atmosférica por dióxido de azufre y partículas, polen y demanda por asma en urgencias hospitalarias del municipio de Madrid", *Gaceta Sanitaria*, Vol. 15 (sup.2), pp. 118.

Tobías, A.M.; Díaz, J.; Sáez, M.; Alberdi, J.C. "Use of poisson regression and Box-Jenkins models to evaluate the short-term effects of environmental noise levels on daily emergency admissions in Madrid", *European Journal of Epidemiology*, Vol. 17, pp. 765-771.

Velasco, C. y Robinson, P.M. "Edgeworth expansions for spectral density estimates and studentized sample mean", *Econometric Theory*, Vol. 17, pp. 497-539.

Velilla, S. "On the bootstrap in misspecified regression models", *Computational Statistics and Data Analysis*, Vol. 36, pp. 227-242.

Wiper, M.P.; Ríos Insua, D.; Ruggeri, F. "Mixtures of gamma distributions with applications", *Journal of Computational and Graphical Statistics*, Vol. 10, pp. 440-454.

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.

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

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

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

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

Martín, I.; Moreno, V.; Torres, F.; Horas, M.; Ríos, J.; 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.

Nuñez, O.; 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., Romo, J.J. "Forecasting time series with sieve bootstrap", *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol. 100, pp. 1-11.

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

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.

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

Ruiz, E.; Lorenzo, P. "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.; 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.; Zhu, L-X. Discussion on "An adaptative estimation of dimension reduction space", *Journal of the Royal Statistical Society, Series B*.

Libros y colaboraciones

Books

2001

Cossin, D. y Aparicio, F.M. Optimal control of credit risk, security collateralization, deposit insurance and other financial guarantees, Kluwer. Monografía.

Peña, D., Tiao, C.G. y Tsay, R. A course in Time series, Wiley, EE.UU.

Peña, D. Fundamentos de Estadística, Alianza Universidad, España.

Peña, D. Regresión y diseño de experimentos, Alianza Universidad, España.

Colaboraciones en obras colectivas

Contributions to joint works

2001

Albacete, R.; Espasa, A. "La predicción de los precios energéticos en la inflación europea", en: Actas del XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa.

Ausin, M.C.; Lillo, R.E.; Wiper, M.P. "Estimación bayesiana para sistemas de colas G/M/1"; en: Actas XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Universidad de Jaén, pp. 107.

Gonzalo, J., Dolado, J.J. y Mármol, F. "Cointegration" en A companion to theoretical econometrics, Basil Blackwell, pp. 624-654.

Gonzalo, J. y Granger, C. "Estimation of common long-memory components in cointegrated systems" en Essays in Econometrics vol. I y II., Cambridge, pp. 232-253.

Kaiser, R.; Maravall, A. "An application of tramo-seats: changes in seasonality and current trend-cycle assessment"; en: ICES II, American Statistical Association, pp. 731-742.

Lillo, R.E.; Escudero, R.; Hernández, E. "Software de simulación de procesos de colas"; en: Actas del XXVI Congreso nacional de Estadística e Investigación Operativa.

Martín-Merino, M., Muñoz, A., Dimitriadis, Y. "Incorporating asymmetry into SOM and Sammon algorithm for visual map generation" en International Joint Conference on Neural Networks, IEEE Press, pp. 1908-1913.

Martín-Merino, M., Muñoz, A. "Self organizing map and Sammon mapping for asymmetric proximities" en International Conference on Artificial Neural Networks (Lecture Notes in Computer Science), Springer Verlag, pp. 429-435.

Muñoz, A.; Martín Merino, M. "New asymmetric iterative scaling models for the generation of textual word maps"; en: Proceeding of the 6th International Conference on Textual Data Statistical Analysis, IRISA-INRIA, pp. 593-603.

Romera, M.R. "Optimal control of partially observable linear quadratic systems with asymmetric observation errors"; en: Actas del XXVI Congreso Nacional de la SEIO, Ubeda.

Sánchez, I. "Estimadores de la densidad espectral en la frecuencia cero para contrastes de raíces unitarias en modelos ARMA"; en: XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Serv. de Publicaciones de la Univ. Jaén, pp. 197.

Sánchez, I. "Modelos de predicción de la oferta de energía eólica"; en: XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Serv. de Publicaciones de la Univ. Jaén, pp. 215.

Wiper, M.P., Pettit, L.I. y Young, K.D.S. "Inferencia bayesiana para algunas leyes de Lanchester" en Congreso sobre Técnicas de ayuda a la decisión en la defensa, Ministerio de Defensa, pp. 171-185.

Wiper, M.P. y Rodríguez Bernal, M.T. "Bayesian inference for a software reliability model using metrics information" en Safety and Reliability: towards a safer world, Politécnico de Torino, pp. 1999-2006.

Wiper, M.P.; Rodríguez, M.T. "Inferencia bayesiana para un modelo de fiabilidad de software utilizando métricas"; en: Actas XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, Universidad de Jaén, pp. 108.

2002

Albacete, R.; 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.; 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.; 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.; 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.

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

2001

Alonso-Borrego, C. y Collado, M.D. "Innovation and job creation and destruction: evidence from Spain". Working Paper AD 2001-25. Instituto Valenciano de Investigaciones Económicas (IVIE).

Alonso-Borrego, C. y Collado, M.D. "Innovation and job creation and destruction: evidence from Spain". WP 01-38 (24). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Alonso-Borrego, C.; Sánchez, R. "GMM estimation of a production function with panel data: an application to spanish manufacturing firms". WP 01-55 (27). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Alonso, A.M., Peña, D. y Romo, J., "Introducing Model Uncertainty in Time Series Bootstrap". WP 01-14 (09). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Alonso, A.M y Romo, J., "Forecast of the Expected Non-epidemic Morbidity of Acute Diseases using Resampling Methods". WP 01-34 (22). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Arrazola, M., de Hevia, J., Risueño, M. y Sanz, J.F. "Estimación y comparación de tasas de rendimiento de la educación en España", Papeles de Trabajo del IEF, 2/01, Instituto de Estudios Fiscales.

Ausín Olivera, M.C., Wiper, M.P. y Lillo, R., "Bayesian Estimation for the M/G/1 queue using a phase type approximation". WP 01-30 (19). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Ausin, M.C.; Lillo, R.E.; Wiper, M.P. "Bayesian inference and prediction for the G/M/1 queueing system" WP 01-41 (26). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Barrios, M.P. y Velilla, S., "A Proposal for a New Dimension Analysis Procedure in a General Regression Problem". WP 01-19 (13). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E., "Outliers and Conditional Autoregressive Heteroscedasticity in Time Series". WP 01-07 (04). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E., "Is Stochastic Volatility more Flexible than GARCH?". WP 01-08 (05). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Conejo, A.J., Nogales, F.J. y Prieto, F.J., "A Decomposition Procedure Based on Approximate Newton Directions". WP 01-09 (06). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Currie, I. y Durbán, M., "Semiparametric Models and P-splines". WP 01-17 (11). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Detle, H., Carsten Von Lieres und Wilkau y Sperlich, S., "A Comparison of Different Nonparametric Methods for Inference on Additive Models". WP 01-28 (18). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Durbán, M. y Glasbey, C., "Weather Modelling Using a Multivariate Latent Gaussian Model". WP 01-16 (10). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Espasa, A., Senra, E. y Albacete, R., "Forecasting inflation in the European monetary union: a disaggregated approach by countries and by sectors". WP 01-37 (23). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Galeano, P. y Peña, D., "Multivariate Analysis in Vector Time Series". WP 01-24 (15). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Hernández, A. y Velilla, S. "Dimension reduction in nonparametric discriminant analysis". WP 01-39 (25). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

de la Horra Navarro, J. y Rodríguez-Bernal, M.T., "Coherence of the Posterior Predictive P-Value Based on the Posterior Odds". WP 01-25 (16). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

de la Horra Navarro, J. y Rodríguez-Bernal, M.T., "Bayesian Robustness of the Posterior Predictive P-Value". WP 01-27 (17). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Nielsen, J.P. y Sperlich, S., "Prediction of Stocks: A New Way to Look at it". WP 01-18 (12). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Pascual, L., Romo, J. y Ruiz, E., "Bootstrap Prediction Intervals for Power-transformed Time Series". WP 01-05 (03). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Peña, D. y Sánchez, I., "New In-Sample Prediction Errors in Time Series with Applications". WP 01-11 (07). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Pérez, A. y Ruiz, E., "Properties of the Sample Autocorrelations in Autoregressive Stochastic Volatility Models". WP 01-12 (08). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Pérez, A. y Ruiz, E., "Modelos de memoria larga para series económicas y financieras". DT 01-01 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Romano, J.P. y Wolf, M., "Improved Nonparametric Confidence Intervals in Time series Regressions". WP 01-02 (01). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Romano, J.P. y Wolf, M., "Explicit Nonparametric Confidence Intervals for the Variance with Guaranteed Coverage". WP 01-03 (02). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Romera, M.R., "Optimal Control of Partially Observable Linear Quadratic Systems with Asymmetric Observation Errors". WP 01-32 (20). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Ruiz, E.; Pérez, A. "Asymmetric long memory GARCH: a reply to Hwang's model". WP 01-62 (29). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sánchez, R. "Estimation of a dynamic discrete choice model of irreversible investment". WP 01-56 (28). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sperlich, S.; Hengartner, Nicolas W. "Rate optimal estimation with the integration method in the presence of many covariates". WP 01-69 (30). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Sperlich, S.; Rodríguez-Poo, J.M.; Vieu, P. "A consistent specification test for semiparametric models". WP 01-70 (31). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Velilla, S.; Hernández, A. "Dimension reduction transformations in discriminant analysis". WP 01-66 (14). Serie de Economía de la Empresa. Universidad Carlos III de Madrid.

Veredas, D., Rodríguez-Poo, J.M. y Espasa, A., "On the (Intradaily) Seasonality and Dynamics of a Financial Point Process: A Semiparametric Approach". WP 01-33 (21). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

Wiper, M.P. y Rodríguez-Bernal, M.T., "Bayesian Inference for a Software Reliability Model Using Software Metrics Information". WP 01-20 (14). Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid.

2002

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, M.R.; 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.

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.

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-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.

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.

VII. CONGRESOS, CONFERENCIAS Y SEMINARIOS.

VII. MEETINGS AND CONFERENCES ATTENDED

Presentaciones en congresos

Meetings

2001

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García, A. "A robust test of dominant low-frequency behaviour in time series" **20th International Symposium on Forecasting**, Lisboa (Portugal).

Aparicio, F.M. "A characterization of cointegrating relationships using induced-order statistics" **20th International Symposium on Forecasting**, Lisboa (Portugal).

Arranz, M.A. y Mármol, F. "Pseudo instrumental variable testing of unit roots", **ERC/METU International Conference in Economics**, Ankara (Turquía).

Arranz, M.A., Escribano, A. y Mármol, F. "Effects of applying linear and nonlinear filters on tests for unit roots with additive outliers", **ERC/METU International Conference in Economics**, Ankara (Turquía).

Arrazola, M., de Hevia, J., Risueño, M. y Sanz, J.F. "Some new evidence on the effects of human capital appreciation on experience-earnings profile", **IV Encuentro de Economía Aplicada**, Reus (España).

Baíllo, A. "Nonparametric estimation of density level sets", **Statistics Odyssey**, París (Francia).

Carnero, M.d.; Peña, D.; Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", **Congreso de SEIO, Ubeda (España)**.

Currie, I.D. y Durbán, M. "Semiparametric models and P-splines", **XVI International Workshop on Statistical Modelling**, Odense (Dinamarca).

Delgado, M.A., Rodríguez-Poo, J. y Wolf, M. "Subsampling cube root asymptotics with an application to Manski's MSE", **European Meeting of the Econometric Society**, Lausanne (Suiza).

Delgado, M.A. y González-Manteiga, W. "Significance testing in nonparametric regresión based on the bootstrap", **X Seminario en Especificación y Validación de Modelos Econométricos**, Zaragoza (España).

Delgado, M.A., Hidalgo, J. y Velasco, C. "Distribution free goodness-of-fit tests for linear processes", **2º Taller de Econometría y Series Temporales**, Bilbao (España).

Dolado, J.J. y Mármol, F. "Some asymptotic inference results for multivariate long-memory proceses", **European Meeting of the Econometric Society**, Lausanne (Suiza).

Dolado, J.J., Gonzalo, J. y Mayoral, L. "Long memory in the Spanish political opinión polls", **Summer Meetings of the European Econometric Society**, Lausanne (Suiza).

Durban, M.L. "P-splines: some applications", **Euroworkshop in Statistical Modelling-Nonparametric models**, Bernried (Alemania).

Espasa, A., Albacete, A. y Senra, E. "Econometric modelling for inflation forecasting", **2º Taller de Econometría y Series Temporales. Departamento de Economía Aplicada.** Fac. de Ciencias Económicas, Universidad del País Vasco, Bilbao (España).

Espasa, A. "Forecasting inflation in the euro-zone", **Workshop on Econometric Models for Economic forecasting**, Roma (Italia).

Espasa, A. "Macroeconomic forecasting approach based on disaggregation, general and specific leading indicators, non-linear schemes and combination of forecasts", **European Network on Business Cycles Analysis**, Comisión Europea. Bruselas.

Espasa, A.; Mayo, I. *Comentarios al trabajo "Convergencia y estabilidad en la Unión Europea" de Fernández-Macho, XIV Simposio de Moneda y Crédito, Madrid (España).*

Gonzalo, J. y Pitarakis, J.Y. "Estimation and model selection based inference in single and multiple threshold models", **Winter Meetings of the North American Econometric Society**, Nueva Orleans (EE.UU.).

Gonzalo, J., "Criterios de información versus contrastes de hipótesis" (por A. Aznar), **X Congreso sobre Especificación de Modelos Económicos**, Zaragoza (España).

Gonzalo, J. y Wolf, M. "Subsampling inference in threshold models", **NBER-NSF Time Series Conference**, Carolina del Norte (EE.UU).

Gonzalo, J. "Threshold stochastic unit root models", **New Approaches to the Study of Economic Fluctuations**, Hydra (Grecia).

Härdle, W., Sperlich, S., Spokoiny, V. "Adaptive tests in additive regression", **EMS**, Madeira (Portugal).

Härdle, W., Huet, S., Mammen, E. y Sperlich, S. "Bootstrap inference in semiparametric generalized additive models", **ESEM**, Lausanne (Suiza).

Muñoz, A.; Martín Merino, M. "Self organizing map and Sammon mapping for asymmetric proximities", **International Conference on Artificial Neural Networks**, Viena (Austria).

Muñoz, A.; Martín Merino, M. "New asymmetric iterative scaling models for the generation of textual word maps", **JADT 2001, Saint Malo (Francia).**

Muñoz, A.; Martín Merino, M. "Incorporating asymmetry into SOM and Sammon algorithm for visual map generation", **International Joint Conference on Neural Networks**, Washington (USA).

Nogales, F.J., Conejo, A. y Prieto, F.J. "A Schur-based decomposition algorithm based on interior-point methods", **Optimization 2001**, Aveiro (Portugal).

Pascual, L. Romo, J. y Ruiz, E. "Forecasting returns and volatilities in GARCH processes using the bootstrap", **Fifth Time Series Workshop of Arrabida**, Arrabida (Portugal).

Pascual, L., Romo, J. y Ruiz, E. "Forecasting returns and volatilities in GARCH processes using the bootstrap" **International Conference on Modelling Volatility**, Perth (Australia).

Peña, D. Conferenciante invitado. "Nuevos métodos para la medición de la calidad de servicio", Escuela de Probabilidad y Estadística, **Centro de Investigación en Matemáticas (CIMAT)**, Guanajuato (México).

Peña, D. Invited speaker. "The SAR procedure for heterogeneity analysis", **International Meeting on Contemporary Data Analysis**, Buenos Aires (Argentina).

Peña, D. Conferenciante invitado. "Measuring the advantages of multivariate versus univariate forecasts", **9th. Escola de Series temporais y econometria**, Minas Gerais Brasil (Brasil).

Peña, D. Invited speaker. "Clustering by projections" **The 53th. Session of the International Statistical Institute**, Seoul (Korea).

Pérez, A., Ruiz, E. "Properties of the sample autocorrelations in autoregressive stochastic volatility models" **International Conference on the Econometrics of Financial markets**, Delphi (Grecia).

Romera, M.R.; Hernández-Lerma, O. "Control of partially observable stochastic systems", **VIII Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática**, La Habana (Cuba).

Sánchez, I. y Peña, D. "New in-sample prediction error in time series with applications", **ISF**, Atlanta (EE.UU).

Velasco, C. "Semiparametric estimation of fractional cointegration" **European Meeting of Statisticians**, Funchal (Portugal).

Velasco, C. "Gaussian semiparametric estimation of fractional cointegration", **X Seminario en especificación y validación de modelos econométricos**, Zaragoza (España).

Velilla, S. *Moderador de la Sesión "Análisis Multivariante IV"*, **XXVI Reunión de la SEIO**, Úbeda (Jaén).

Velilla, S.; Barrios, P. "Elección flexible de franjas en el método SIR", **XXVI Reunión de la SEIO**, Úbeda (Jaén).

Velilla, S.; Hernández, A. "Transformaciones reductoras de la dimensión en análisis discriminante", **XXVI Reunión de la SEIO**, Úbeda (Jaén).

Veredas, D., Rodríguez-Poo, J. y Espasa, A. "On the (intradaily) seasonality and dynamics of a financial point process: a semiparametric approach", **European Meeting of the Econometric Society**, Basilea.

Wiper, M.P.; Rodríguez, M.T. "Bayesian inference for a software reliability model using metrics information", **Congreso ADIS 2001**, Almagro (España).

2002

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Conferences and seminars

Conferencias y seminarios impartidos

2001

Albacete, R. "Forecasting inflation in the European monetary union: a disaggregated approach by countries and by sectors", **Seminario de Economía del Departamento de Economía Aplicada en la Universidad de Jaén, Jaén (España)**.

Aparicio, F.M., Escribano, A. y García, A. "A robust test of unit roots in time series" **Seminario de Estadística en la Universidad de Friburgo, Friburgo (Suiza)**.

Arrazola, M. "Métodos microeconómicos", **Departamento de Economía Aplicada VI de la Universidad Complutense de Madrid, Madrid (España)**.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Departamento de Econometría, Universidad Autónoma de Madrid, Madrid (España)*.

Carnero, M.A., Peña, D. y Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Departamento de Estadística y Econometría, Universidad de La Laguna, La Laguna (España)*.

Carnero, M.d.; Peña, D.; Ruiz, E. "Is stochastic volatility more flexible than GARCH?", *Seminario del Departamento de Estadística de la Universidad del País Vasco, Bilbao (España)*.

Espasa, A., Senra, E. y Albacete, A. "Forecasting inflation in the European monetary union: a disaggregated approach by countries and by sectors". *Seminario en la Universidad Complutense de Madrid, Madrid (España)*

Espasa, A., Senra, E. y Albacete, A. "Forecasting inflation in the European monetary union: a disaggregated approach by countries and by sectors". *Seminario en la Universidad de Valencia, Valencia (España)*.

Espasa, A. Discusión del trabajo "Construction of an index of labour market adaptability for EU member states, the US and Japan by a common methodology and with a network of experts", *Seminario en la Comisión Europea. Bruselas*.

Gonzalo, J. y Pitarakis, J.Y. "Estimation and model selection based inference in single and multiple threshold models", *Seminario en el Departamento de Economía de Boston University (EE.UU)*.

Gonzalo, J. "Threshold stochastic unit root models", *Seminario en University of London (Inglaterra)*.

Härdle, W., Sperlich, S. y Spokoiny, V. "Structural tests in additive regression", *Seminario semanal del Departamento de Economía, Universidad del País Vasco, Bilbao (España)*.

Núñez, O. "Estimation of income distribution via mixture", *Seminario, París (Francia)*.

Pascual, L., Romo, J. y Ruiz, E. "Forecasting returns and volatilities in GARCH proceses using the bootstrap", *Departamento de Econometría y Estadística, Universidad de Valladolid, Valladolid (España)*.

Peña, D. "Multivariate time series forecasting". *Seminario en the University of Illinois, Urbana (EE.UU.)*

Peña, D. "Projections that maximize and minimize kurtosis for outlier detection and clustering" *Seminario en Instituto Tecnológico Autónomo de México (México)*.

Rodríguez-Poo, J.M., Sperlich, S. y Vieu, Ph. "Estimation and testing in latent separable models", *Seminario semanal del Sonderforschungsbereich 475, Dortmund (Alemania)*.

Romo, J.J.; Ruiz, E.; Pascual, L. "Bootstrap prediction of GARCH models", *Seminario del Departamento de Estadística y Econometría de la Universidad de Valladolid, Valladolid (España), 2001*.

Wiper, M.P. "Bayesian inference for software reliability models given metrics and failure time data", *Seminario CNR/IAMI, Milán (Italia), 2001*.

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)*, 2002.

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

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

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

Espasa, A. "Metodología moderna para el análisis de la coyuntura económica", *Ciclo "Seminari de Finances de Barcelona, Barcelona (España)*, 2002.

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

Romo, J.J. "El bootstrap y sus aplicaciones", *Seminario del Departamento de Estadística. Universidad Pública de Navarra, Pamplona*, 2002.

Romo, J.J.; Ruiz, E.; Pascual, L. "Bootstrap prediction intervals for GARCH models", *Seminario del Departamento de Economía de la University of Canterbury, Christchurch (Nueva Zelanda)*, 2002.

Romo, J.J.; Ruiz, E.; Pascual, L. "Bootstrap prediction intervals for GARCH models", *Seminario del Departamento de Economía de la University of New South Wales, Sidney (Australia)*, 2002.

Estancias en otros centros

Visits to other Departments

2001

Aparicio, F.M.

“Teoría asintótica de tests no paramétricos de raíces unitarias basados en registros” en la University of Bergen con Dag Tjøstheim. *Duración:* 28/06/01 a 23/09/01.

Gonzalo, J.

“Modelos thresholds y raíces unitarias” en la Boston University y financiado parcialmente por parte de la DGYCIT (PB98-0026). *Duración:* 7/01/01 a 14/01/01.

“Modelos thresholds y criterios de información” en la University of Reading y financiado parcialmente por la University of London. *Duración:* 26/03/01 a 31/03/01.

Lillo, R.

“Modelización algorítmica: aplicaciones a modelos de producción, sistemas de comunicaciones y modelos de contención” en Department of Systems and Industrial Engineering, University of Arizona (EE.UU.) *Duración:* 6/6/01 a 4/19/01.

Núñez, O.

Trabajo de investigación en Maison des Sciences Economiques, París 1, Sorbonne (Francia) financiado por el Ministère de la Recherche. *Duración:* 1/12/01 a 10/12/2001.

Peña, D.

“Series temporales” en Universidad de Chicago (EE.UU) financiado por la Universidad de Chicago y la CICYT. *Duración:* 21/3/01 a 22/06/01.

“Métodos bayesianos y BMA” en la Universidad de Búfalo (EE.UU) junto a Irwin Guttman y financiado por la Universidad de Búfalo y la CICYT. *Duración:* 13/06/01 a 19/06/01.

“Bayesian robust sensitivity” en la Universidad de British Columbia (Canadá) junto a Rubén Zamar y financiado por la Universidad de Chicago. *Duración:* 1/06/01 a 12/06/01.

“Métodos multivariantes” en el Centro de Investigación en matemáticas (CIMAT) Guanajuato (México) financiado por el CIMAT y la CICYT. *Duración:* 3/02/01 a 11/02/01.

Sperlich, S.

“Multi index models” con V. Spokoiny y J. Polzehl en WIAS, Berlín financiado por WIAS y Deutsche Forschungs Gemeinschaft. *Duración:* 5/12/00 a 12/01/01.

“Testing separability” con U. Gather y H. Dette en las Universidades de Dortmund y Bochum (Alemania) y financiado por la Universidad de Dortmund y Deutsche Forschungs Gemeinschaft. *Duración:* 10/07/01 a 17/07/01.

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.

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.

**VIII. SEMINARIOS IMPARTIDOS EN
EL DEPARTAMENTO**

VIII. DEPARTMENT SEMINARS

2001

MOUNA HASSAN (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de Tesis: "Procedimientos de mejora de la eficiencia computacional en métodos de punto interior para optimización no convexa"*. 26 de enero de 2001.

CLARA M^a GRANADOS (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de Tesis: "Técnicas multivariantes y bayesianas para recuperación de la información en bases de datos dinámicas"* 26 de enero de 2001.

SARA LÓPEZ (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de Tesis: "Inferencia para datos funcionales"* 2 de febrero de 2001.

JOSÉ OLMO (Universidad Carlos III de Madrid). *Propuesta de Tesis: "Applications of extreme value theory to risk measures"*. 2 de febrero de 2001.

M^a JESÚS BAYARRI (Universidad de Valencia) *"Definición de p-valores en la crítica de modelos"*. 9 de febrero de 2001.

FÉLIX BELZUNCE (Universidad de Murcia) *"Comparaciones estocásticas de modelos de variables ordenadas"*. 16 de febrero de 2001.

JENS PERCH NIELSEN (Codan Seguros, Copenhagen) *"Prediction of stocks: a new way to look at it"*. 23 de febrero de 2001.

JOERG POLZEHL (Weierstrass Institut Berlin) *"Structural adaption in non-parametric smoothing"*. 2 de marzo de 2001.

BO HONORE (Princeton University) *"Estimation of cross sectional and panel data censored regressions models with endogeneity"* 16 de marzo de 2001.

LORENZO PASCUAL (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de tesis: "Intervalos de predicción bootstrap en modelos lineales y no lineales de series temporales"* 20 de marzo de 2001.

ANDRÉS ALONSO (Universidad Carlos III de Madrid). *Seminario de tesis: "Técnicas de remuestreo y datos omitidos en series temporales"*. 22 de marzo de 2001.

SIMON WILSON (Trinity College Dublin) *"How long to test software: a decision theory solution"*. 23 de marzo de 2001.

EMMANUEL FLACHAIRE (London School of Economics). Seminario de contratación: *"The wild bootstrap, tamed at last"*. 27 de marzo de 2001.

AMPARO BAÍLLO (Universidad Autónoma de Madrid). Seminario de contratación: *"Estimación no paramétrica de conjuntos de niveles"*. 29 de marzo de 2001.

BURAK SALTOGLU (Marmara University) *"Evaluating predictive performance of VaR models in emerging markets: a reality check"*. 30 de marzo de 2001.

TERESA ORTUÑO (UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID). Seminario de contratación: *"El problema del ordenamiento secuencial: análisis poliédrico en un entorno Dual"*. 2 de abril de 2001.

ALBERTO LUCEÑO (Universidad de Cantabria). *"Esquema de ajuste con banda muerta para control de calidad on-line"*. 20 de abril de 2001.

MANUEL ARELLANO (CEMFI). *"Discrete choices with panel data"*. 27 de abril de 2001.

PILAR BARRIOS (Universidad Carlos III de Madrid). Seminario de Tesis: *"Contrastes de dimensión de tipo bootstrap en problemas generales de regresión"*. 4 de mayo de 2001.

CARSTEN TANGGARD (Aarhus Business School). *"Evaluating the C-CAPM and the equity premium puzzle at short and long horizons: Markovian bootstrap approach"*. 11 de mayo de 2001.

DAVID YOUNG (Opti-market Consulting, Madrid). *"Modeling consumer's choices for different products"*. 18 de mayo de 2001.

TIMO TERASVIRTA (Stockholm School of Economics). *"Statistical properties of volatility models and stylized facts of financial time series"*. 1 de junio de 2001.

ANDREW HARVEY (Cambridge University). *"The econometrics of stability and convergence"*. 8 de junio de 2001.

VLADIMIR SPOKOINY (Weierstrass Institute, Berlin) *"Structural adaptive methods in nonparametric smoothing with applications"*. 5 de octubre de 2001.

ENRIQUE SENTANA (CEMFI) *"The score of conditionally heteroskedastic dynamic regression models with student t innovations and a LM test for multivariate normality"*. 19 de octubre de 2001.

ANTONIS DEMOS (Athens University of Economics and Business) *"A family of time-varying generalized stochastic volatility in mean models. Time dependence and higher moments"*. 26 de octubre de 2001.

ARMINDA MORENO (Universidad Politécnica de Madrid). *"Modelos de regresión para variables ordinales"*. 16 de noviembre de 2001.

IAIN CURRIE (Herriot Watt University). *"P-splines: your flexible smoother"*. 23 de noviembre de 2001.

FRANCISCO APARISI (Universitat de Valencia). *"Planes de muestreo óptimos en el gráfico de control de calidad T2 de Hotelling"*. 30 de noviembre de 2001

JUAN MIGUEL MARÍN (Universidad Rey Juan Carlos I, Madrid). *"Inferencia en algunos modelos estocásticos aplicados a la gestión de granjas porcinas"*. 14 de diciembre de 2001.

MARCO REALE (University of Canterbury, Nueva Zelanda). *"Conditional independence graphs and Granger causality for VAR models"*. 21 de diciembre de 2001.

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 micro model”*. 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.