# 

CURRICULUM VITAE

Nombre y Apellidos: ESTHER RUIZ ORTEGA

Fecha: 4 de mayo de 2023

Firma:

El abajo firmante declara que son ciertos los datos que figuran en este currículum, asumiendo en caso contrario las responsabilidades que pudieran derivarse de las inexactitudes que consten en el mismo.

**ÍNDICE**

[1 TÍTULOS ACADÉMICOS 5](#_Toc167782594)

[2 PUESTOS DOCENTES DESEMPEÑADOS 5](#_Toc167782595)

[3 ACTIVIDAD DOCENTE DESEMPEÑADA 6](#_Toc167782597)

[3.1 Primer y Segundo Ciclo 6](#_Toc167782598)

[3.2 Tercer Ciclo 6](#_Toc167782599)

[3.3 Quinquenios de Docencia 6](#_Toc167782600)

[4 ACTIVIDAD INVESTIGADORA 7](#_Toc167782602)

[4.1 Tesis doctorales dirigidas 7](#_Toc167782603)

[4.2 Evaluación de la actividad investigadora 13](#_Toc167782604)

[5 PUBLICACIONES, LIBROS 13](#_Toc167782605)

[6 PUBLICACIONES, ARTÍCULOS 14](#_Toc167782606)

[7 OTRAS PUBLICACIONES 23](#_Toc167782609)

[7.1 Trabajos publicados sin evaluación anónima 24](#_Toc167782610)

[7.2 Documentos de trabajo. 26](#_Toc167782611)

[7.3 Edición de Números Especiales de revistas y libros 52](#_Toc167782612)

[8 OTROS TRABAJOS DE INVESTIGACIÓN 26](#_Toc167782613)

[9 PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN SUBVENCIONADOS 27](#_Toc167782614)

[10 COMUNICACIONES Y PONENCIAS PRESENTADAS A CONGRESOS 30](#_Toc167782615)

[10.1 Congresos Internacionales 30](#_Toc167782616)

[10.2 Congresos Nacionales 38](#_Toc167782617)

[10.3 Comentarios de ponencias 39](#_Toc167782618)

[10.4 Workshops 40](#_Toc167782619)

[11 CURSOS Y SEMINARIOS IMPARTIDOS 43](#_Toc167782621)

[11.1 Cursos 44](#_Toc167782622)

[11.2 Seminarios 44](#_Toc167782623)

[12 BECAS, AYUDAS, RECONOCIMIENTOS Y PREMIOS RECIBIDOS 45](#_Toc167782625)

[13 ACTIVIDAD EN EMPRESAS Y PROFESIÓN LIBRE 46](#_Toc167782626)

[14 OTROS MÉRITOS DOCENTES O DE INVESTIGACIÓN 47](#_Toc167782627)

[14.1 Participación en Tribunales de Tesis Doctorales 47](#_Toc167782628)

[14.2 Evaluación de revistas científicas y documentos de trabajo 51](#_Toc167782630)

[14.3 Miembro de comités editoriales de revistas científicas 51](#_Toc167782630)

[14.4 Miembro de Asociaciones Científicas 52](#_Toc167782631)

[14.5 Miembro de Comités Evaluadores 53](#_Toc167782632)

[15 OTROS MÉRITOS 54](#_Toc167782634)

Apellidos y Nombre: **RUIZ ORTEGA, Esther**

Documento Nacional de Identidad: 72390042A

Nacimiento:

Fecha: 23 de julio de 1961

Localidad: Santurce

Provincia: Vizcaya

Residencia:

Dirección: Avda. de Badajoz 23, 9º B

Localidad: Madrid

Provincia: Madrid

Teléfono: 914034467

Categoría Actual como docente: Profesora Catedrática de Universidad

Departamento: Estadística

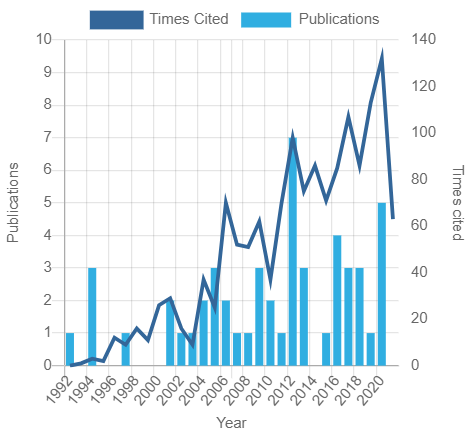
Facultad: Ciencias Sociales y Jurídicas

Universidad: Carlos III de Madrid

Dirección: C/ Madrid, 126, 28903 Getafe, Madrid

En junio 2021, la base de datos RePEc/IDEAS me sitúa en el 2.2% superior entre mujeres economistas a nivel mundial (363 de 16164) y en el 2.6% entre los economistas españoles (62 de 2410). Además, entre todos los autores a nivel mundial, estoy situada en el 5% superior de acuerdo con varios criterios como, por ejemplo, número de contribuciones y de citas, en el 4% superior en el número de doctorandos y en el 6% superior en el índice-h.

En julio 2021, el número de citas en **JCR es** 1454 (h-index 17). (Web of Science Researcher ID: L-1737-2014)



En julio 2021, el número de citas en **Google Scholar** es 5183 (índice-h 26)

# TÍTULOS ACADÉMICOS

· LICENCIATURA EN CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES (SECCIÓN EMPRESARIALES)

CENTRO: Ftad. de Ciencias Económicas y Empresariales

ORGANISMO: Universidad del País Vasco, Bilbao

FECHA: 1984

· MASTER OF SCIENCE IN STATISTICS

CENTRO: London School of Economics and Political Science

ORGANISMO: University of London, Londres

FECHA: 1988

· DOCTOR OF PHILOSOPHY.

Título de la tesis:"Heterocedasticity in financial time series", Dirección: Profesor Dr. Andrew C. HARVEY.

CENTRO: London School of Economics and Political Science

ORGANISMO: University of London, Londres

FECHA: 1992

Título homologado al título español de DOCTOR EN CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES (SECCIÓN ECONÓMICAS).

MINISTERIO DE EDUCACIÓN Y CIENCIA, 1993

# PUESTOS DOCENTES DESEMPEÑADOS

· PROFESOR COLABORADOR

CENTRO**:** Dpto. de Econometría, Ftad. de Ciencias Económicas y Empresariales, Universidad del País Vasco.

DEDICACIÓN: Exclusiva.

FECHA: Octubre1985 / Septiembre1987.

· PROFESOR VISITANTE (LECTURER)

CENTRO: Dpto. de Estadística*,* London School of Economics and Political Science (University of London).

DEDICACIÓN: Exclusiva.

FECHA: Septiembre1991 / Septiembre1992.

**·** PROFESOR VISITANTE

CENTRO: Dpto. de Estadística y Econometría, Ftad. de Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid.

DEDICACIÓN: Exclusiva.

FECHA: Septiembre 1992 / Febrero 1995.

· PROFESOR TITULAR DEL ÁREA DE CONOCIMIENTO DE FUNDAMENTOS DEL ANÁLISIS ECONÓMICO.

CENTRO: Dpto. de Estadística y Econometría, Ftad. de Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid.

DEDICACIÓN: Tiempo completo.

FECHA: Febrero 1995 / Mayo 2008.

· PROFESOR CATEDRÁTICO DEL ÁREA DE CONOCIMIENTO DE FUNDAMENTOS DEL ANÁLISIS ECONÓMICO.

CENTRO: Dpto. de Estadística, Ftad. de Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid.

DEDICACIÓN: Tiempo completo.

FECHA: Mayo 2008 / Actualidad.

1. **ACTIVIDAD DOCENTE DESEMPEÑADA**

# Primer y Segundo Ciclo

**Docencia**

· Docencia en el Departamento de Econometría, Ftad. de Ciencias Económicas y Empresariales, **Universidad del País Vasco**, 1985-1987: Investigación Operativa (ADE), Introducción a la Econometría (Económicas y ADE).

· Docencia en el Departamento de Estadística, **London School of Economics**, 1991-1992: Statistical Methods for Social Research (B.Sc. in Economics), Introduction to Probability (B.Sc. in Economics), Time Series and Forecasting for Management (B.Sc. in Economics).

· Docencia en el Departamento de Estadística y Econometría, Ftad. Ciencias Sociales y Jurídicas, **Universidad Carlos III de Madrid**, 1992-actualidad: Estadística I (Estudios conjuntos Eco-Der. y ADE-Der.), Estadística II (Estudios conjuntos Eco-Der. y ADE.), Técnicas de Predicción (ADE), Econometría I (Economía, ADE, Conjunta Der.-ADE, Estadística), Econometría II (Economía, ADE, Conjunta Der.-ADE), Series Temporales (Estadística), Econometría (Estadística), Econometría Financiera (Grado en Finanzas y Contabilidad).

**Coordinación**

· Asignaturas coordinadas en el Departamento de Estadística y Econometría, Ftad. Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid, 1992-actualidad: Estadística II (Economía, ADE y conjuntas Economía-Dcho. y ADE-Dcho), Econometría (Estadística), Métodos Estadísticos (Ciencias Empresariales), Estadística II (Ciencias Empresariales), Econometría Diplomatura en Estadística), Técnicas de Previsión (Grado conjunto en Estudios Internacionales y Derecho, Grado conjunto en Estudios Internacionales y Ciencias Políticas), Econometría II (Grado en Finanzas y Contabilidad).

# Tercer Ciclo

· Docencia en el Departamento de Estadística y Econometría, Ftad. Ciencias Sociales y Jurídicas, **Universidad Carlos III de Madrid**, 1992-actualidad: Modelos dinámicos (Doctorado en Economía), Econometría (Doctorado en Empresa y Métodos Cuantitativos), Econometría Financiera (Doctorado en Empresa y Métodos Cuantitativos), Econometría y Series Temporales (Máster en Análisis Financiero Avanzado), Estadística Financiera (Máster in Finance), Quantitative Methods for Management (Máster in Management), Estadística I (Máster in Social Sciences).

# Quinquenios de Docencia

A la fecha tengo 7 quinquenios de docencia correspondientes a los siguientes períodos:

01/10/1985 - 30/09/1990

01/10/1990 - 30/09/1995

01/10/1995 - 30/09/2000

01/10/2000 - 30/09/2005

01/10/2005 - 30/09/2010

01/10/2010 - 30/09/2015

01/10/2015 - 30/09/2020

* 1. **Cartas de reconocimiento de la actividad docente**

**·** Reconocimiento de la excelencia de la labor docente por parte del Rector y de la Vicerrectora de Ordenación Académica de la Universidad Carlos III de Madrid para diversas asignaturas entre los años 1996 y 2022.

* 1. **Participación en programas internacionales**

· Misión docente Erasmus con la Ecole Normale Superieure de Cachan, Paris, 2006-2007.

· Proyecto TEMPUS-ERASMUS MUNDUS (Dirección General de Educación y Cultura, Comisión Europea) JEP\_40015\_2005 para la organización e impartición del master “Statistical Methods for Business and Economics SMBE” en la universidad de Ss. Cyril and Methodius, Faculty of Economics-Skopje (Macedonia), duración: 2006-2009.

· Co-tutora de la estancia de investigación del alumno de Maestría en Economía Aplicada (MEA), Jorge Ignacio Rodríguez Carranza, de El Colegio de la Frontera Norte, durante el periodo del 7 de enero al 9 de abril de 2018.

# ACTIVIDAD INVESTIGADORA

# Tesis doctorales dirigidas

**DOCTORANDO: Nuria HERNÁNDEZ NANCLARES**.

Co-Director de la Tesis: D. Cándido Pañeda.

CENTRO: Dpto. de Economía Aplicada, Universidad de Oviedo.

TÍTULO: Los efectos internacionales de la política agraria común en el sector de la carne del vacuno*.*

FECHA: Diciembre 1999.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad. Premio extraordinario del doctorado en Economía.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Hernández, N., E. Ruiz y C. Pañeda (2002), Relaciones dinámicas en el mercado internacional de carne de vacuno, *Revista de Economía Aplicada*, 10(29), 137-149.

POSICIÓN ACTUAL: Profesora Titular del departamento de Economía Aplicada, Universidad de Oviedo

**DOCTORANDO: Ana PÉREZ**.

CENTRO: Dpto. de Economía Aplicada (Estadística y Econometría), Universidad de Valladolid

TÍTULO: Estimación e identificación de modelos de volatilidad estocástica con memoria larga.

FECHA: Noviembre 2000.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad. Premio extraordinario del doctorado en Ciencias Empresariales.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Pérez, A. y E. Ruiz (2001), Finite simple properties of a QML estimator of Stochastic Volatility models with long memory, *Economics Letters,* 70, 2, 157-164.

· Pérez, A. y E. Ruiz (2002), Modelos de memoria larga para series económicas y financieras, *Investigaciones Económicas,* 26, 3, 359-410.

· Pérez, A. y E. Ruiz (2003), Properties of the sample autocorrelations of non-linear transformations in long memory stochastic volatility models, *Journal of Financial Econometrics,* 1, 3, 420-444.

POSICIÓN ACTUAL: Profesora Titular del departamento de Economía Aplicada: Estadística y Econometría de la Universidad de Valladolid.

**DOCTORANDO: Lorenzo PASCUAL**.

Co-Director de la Tesis: J. Romo.

CENTRO: Dpto. de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Predicción bootstrap en series temporales.

FECHA: Julio 2001.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad. Premio extraordinario del doctorado en Ingeniería Matemática.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz (2001), Effects of parameter estimation on prediction densities: a bootstrap approach, *International Journal of Forecasting,* 17, 1, 83-103.

· Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz (2004), Bootstrap predictive inference for ARIMA processes, *Journal of Time Series Analysis,* 25, 449-465.

· Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz (2004), Bootstrap prediction intervals for power-transformed time series, *International Journal of Forecasting,* 21, 219-235.

· Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz (2004), Forecasting returns and volatilities in GARCH processes using the bootstrap, *Computational Statistics & Data Analysis,* 50, 2293-2312.

POSICIÓN ACTUAL: Director de riesgos en Deloitte.

**DOCTORANDO: Ángeles CARNERO**.

Co-Director: Daniel Peña.

CENTRO: Dpto. de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Heterocedasticidad condicional, atípicos y cambios de nivel en series temporales financieras.

FECHA: Febrero 2003.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz (2001), Outliers and conditional autoregressive heteroscedasticity in time series, *Estadística,* 53, 143-213.

· Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz (2004), Persistence and kurtosis in GARCH and Stochastic Volatility models, *Journal of Financial Econometrics,* 2, 319-342.

· Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz (2007), Effects of outliers on the identification and estimation of GARCH models, *Journal of Time Series Analysis*, 28(4), 471-497*.*

POSICIÓN ACTUAL: Profesora Titular del departamento de Fundamentos de Análisis Económico de la universidad de Alicante.

**DOCTORANDO: Carmen BROTO**.

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Estimación de modelos de volatilidad estocástica y modelos de componentes inobservados condicionalmente heterocedásticos.

FECHA: Septiembre 2004

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Broto, C. y E. Ruiz (2004), Estimation methods for Stochastic Volatility Models: A Survey, *Journal of Economic Surveys,* 18, 613-649.

· Broto, C. y E. Ruiz (2004), Unobserved Component models with asymmetric condicional variantes, *Computacional Statistics and Data Analysis,* 50, 2146-2166.

POSICIÓN ACTUAL: Senior Economist, Banco de España, Internal Affairs

**DOCTORANDO: Santiago PELLEGRINI**.

Co-director: Antoni Espasa

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Predicción en modelos de componentes inobservados con heterocedasticidad condicional

FECHA: Junio 2009

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Pellegrini, S., E. Ruiz y A. Espasa (2010), Conditionally heteroscedastic unobserved component models and their reduced form, *Economics Letters,* 107(2), 88-90*.*

·Pellegrini, S., E. Ruiz y A. Espasa (2011), Prediction intervals in conditionally heteroscedastic time series with stochastic components, *International Journal of Forecasting*, 27, 308-319*.*

POSICIÓN ACTUAL: Team Lead of Middle Office, markets division, Repsol S.A.

**DOCTORANDO: Alejandro RODRÍGUEZ**.

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Bootstrapping unobserved component models

FECHA: Abril 2010

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Rodríguez, A. y E. Ruiz (2009), Bootstrap Prediction Intervals in State Space Models, *Journal of Time Series Analysis*, 30(2), 167-178.

· Rodríguez, A. y E. Ruiz (2012), Bootstrap prediction mean squared errors of unobserved states based on the Kalman filter with estimated parameters, *Computational Statistics & Data Analysis*, 56, 62-74

POSICIÓN ACTUAL: Profesor visitante, Universidad de Talca (Chile).

**DOCTORANDO: Andre SANTOS**

Co-Director de la Tesis: Javier Nogales

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Multivariate volatility models in financial risk management and portfolio selection

FECHA: Junio 2010.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Santos. A.A.P., F.J. Nogales, E. Ruiz y D. van Dijk (2012), Optimal portfolios with minimum capital requirements, *Journal of Banking and Finance*, 36(7), 1928-1942.

· Santos, A.A.P., F.J. Nogales y E. Ruiz (2013), Comparing univariate and multivariate models to forecast portfolio Value-at-Risk, *Journal of Financial Econometrics*, 11(2), 400-441.

POSICIÓN ACTUAL: Profesor Titular (Associate Professor), on leave, Universidad Federal de Santa Catarina (Brasil). Lecturer in Predictive Analytics, Business School of University of Edinburgh.

**DOCTORANDO: María Rosa NIETO**

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Estimación de riesgo financiero

FECHA: Julio 2010.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

· Nieto, M.R. y E. Ruiz (2016), Frontiers in VaR forecasting and backtesting, *International Journal of Forecasting*, 32, 475-501.

POSICIÓN ACTUAL: Universidad Anahuac, México.

**DOCTORANDO: María José RODRÍGUEZ**

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Volatility models with leverage effects

FECHA: Febrero 2011.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente CUM LAUDE por unanimidad.

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Rodríguez, M.J. y E. Ruiz (2012), GARCH models with leverage effect: differences and similarities, *Journal of Financial Econometrics,* 10(4), 637-668.

POSICIÓN ACTUAL: Gestor de riesgos, Caja Laboral.

**DOCTORANDO: Diego FRESOLI**

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Bootstrap forecasts of multivariate time series

FECHA: Julio 2014.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Fresoli, D., E. Ruiz y L. Pascual (2015), Bootstrap Multi-step Forecasts of Non-Gaussian VAR Models, *International Journal of Forecasting,* 31(3), 834-848.

· Fresoli, D. and E. Ruiz (2016), The uncertainty of conditional returns, volatilities and correlations in DCC models, *Computational Statistics & Data Analysis*, 100, 170-185.

POSICIÓN ACTUAL: Profesor visitante del departamento de Fundamentos del Análisis Económico (Econometría) de la universidad Autónoma de Madrid.

**DOCTORANDO: Xiuping MAO**

Co-Directora de la Tesis: Maria Helena Veiga

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Asymmetric stochastic volatility models

FECHA: Marzo 2015.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Mao, X., E. Ruiz y M.H. Veiga (2017), Threshold stochastic volatility models, *International Journal of Forecasting,* 33(4), 1105-1123.

· Mao, X., V. Czellar, E. Ruiz and M.H. Veiga (2019), Asymmetric stochastic volatility models: properties and particle filter-based simulated maximum likelihood estimation, *Econometrics and Statistics.*

POSICIÓN ACTUAL: Zhongnan University.

**DOCTORANDO: Julieta Fuentes**

Co-Directores de la Tesis: Pilar Poncela y Julio Rodríguez

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Essays on forecasting with partial least squares methods

FECHA: Marzo 2015.

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

POSICIÓN ACTUAL: Banco Central de Reserva de El Salvador.

**DOCTORANDO: Carlos Trucíos**

Co-Director de la Tesis: Luiz Hotta

CENTRO: Instituto de Matemática, Estadística e Computacao Científica, Universidade Estadual de Campinas

TÍTULO: Bootstrap forecast densities in univariate and multivariate volatility models

FECHA: Agosto 2016

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Trucíos, C., L. Hotta y E. Ruiz (2017), Robust bootstrap forecast densities for GARCH returns and volatilities, *Journal of Statistical Computation and Simulation*, 87(16)

· Trucíos, C., L. Hotta y E. Ruiz (2018), Dynamic conditional correlations: Implications for portfolio selection and value-at-risk, *Journal of Statistical Computation and Simulation*, 88(10), 1976-2000

POSICIÓN ACTUAL: Estadístico/Data Science en Atlas Quantum

**DOCTORANDO: Daniel Almeida**

Co-Director de la Tesis: Luiz Hotta

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Essays on expected equity returns and volatility: modeling and prediction

FECHA: 29 Septiembre 2016

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· De Almeida, D., L.K. Hotta and E. Ruiz (2018), MGARCH models: Trade-off between feasibility and flexibility, *International Journal of Forecasting*, 34, 45-63.

POSICIÓN ACTUAL: Banco Votorantim

**DOCTORANDO: Joao Enrique Goncalves Maezzu**

Co-Directora de la Tesis: María Helena Veiga

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Topics in density forecast in parametric univariate time series models

FECHA: 20 Diciembre 2016

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Maezzu, J.H.G., E. Ruiz y H. Veiga (2018), Model uncertainty and the forecast accuracy of ARMA models: A survey, *Journal of Economic Surveys*, 32(2), 388-419

POSICIÓN ACTUAL: Post doc in Universidad de Campinas

**DOCTORANDO: Francisco Coronas**

Co-Directora de la Tesis: Pilar Poncela

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Non-stationary dynamic factor models

FECHA: 14 de julio de 2017

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· Coronas, F., P. Poncela y E. Ruiz (2017), Determining the number of factors after stationary univariate transformations, *Empirical Economics*, 53, 351-372.

· Coronas, F., P. Poncela y E. Ruiz (en prensa), Estimating non-stationary common factors: Implications for risk sharing, Computational Economics

POSICIÓN ACTUAL: Investigador en el Instituto de Estadística y Geografía (INEGI), México

**DOCTORANDO: Javier Maldonado**

Co-directora de la tesis: Irene Albarrán

CENTRO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: Measuring uncertainty of factors extracted using Principal Components

FECHA: 21 de marzo de 2019

CALIFICACIÓN: Sobresaliente Cum Laude por unanimidad

PUBLICACIONES DERIVADAS DE LA TESIS:

· González-Rivera, G., E. Ruiz and J. Vicente (2019), Growth in Stress, *International Journal of Forecasting*, 35(3), 948-966.

· J.V. Maldonado and E. Ruiz (202), *Oxford Bulletin of Economics and Statistics,*

POSICIÓN ACTUAL: Postdoc UC3M

# Evaluación de la actividad investigadora

**Cinco** sexenios de investigación:

Tramo 1:ValoraciónPOSITIVA de la actividad investigadora del periodo comprendido entre 1986/1995 (ambos inclusive).

Tramo 2: Valoración POSITIVA de la actividad investigadora del periodo comprendido entre 1997/2002 (ambos inclusive).

Tramo 3:ValoraciónPOSITIVA de la actividad investigadora del periodo comprendido entre 2003/2008 (ambos inclusive).

Tramo 4: ValoraciónPOSITIVA de la actividad investigadora del periodo comprendido entre 2009/2014 (ambos inclusive).

Tramo 5: ValoraciónPOSITIVA de la actividad investigadora del periodo comprendido entre 2015/2020 (ambos inclusive).

# 

# PUBLICACIONES, LIBROS

AUTOR: R.F. Engle (editor)

TÍTULO: ARCH: Selected readings

FECHA: 1995

EDITORIAL: Oxford University Press.

CAPÍTULO: Multivariate Stochastic Variance Models, con A.C. Harvey y N. G. Shephard, reproducido de *Review of Economic Studies***,** 61, 247-264, 1994.

AUTOR: Newbold, P. y S.J. Leyburne (editores)

TÍTULO: Recent developments in Time Series

FECHA:2003

EDITORIAL: Edgard Elgar.

DOS CAPÍTULOS:

1. Multivariate Stochastic Variance Models, con A.C. Harvey y N. G. Shephard, reproducido de *Review of Economic Studies*, 61, 247-264, 1994.

2. Quasi-Maximum Likelihood estimation of Stochastic Volatility models,reproducido de *Journal of Econometrics*, 63, 289-306, 1994.

AUTOR: Shephard, N.G. (editor)

TÍTULO: Selected Readings for Stochastic Volatility

FECHA: 2005

EDITORIAL: Oxford University Press.

CAPÍTULO: Multivariate Stochastic Variance Models, con A.C. Harvey y N. G. Shephard, reproducido de *Review of Economic Studies*, 61, 247-264, 1994.

AUTOR: M. McAleer y L. Oxley (editores)

TÍTULO: Contributions to Financial Econometrics: Theoretical and Practical Issues

FECHA: 2002

EDITORIAL: Blackwell

CAPÍTULO: Bootstrapping Financial Time Series, con L. Pascual, reproducido de *Journal of Economic Surveys,* 16, 271-300.

AUTOR: R. Baeza-Yates, J. Glaz, H. Gzil, J. Hüsler y J.L. Palacios (editores)

TíTULO: Recent Advances in Applied Probability

FECHA: 2005

EDITORIAL: Springer.

CAPÍTULO: An overview of probabilistic and time series models in finance, con A. Balbás y M.R. Romera.

AUTOR: S.J. Koopman y N.G. Shephard (editores)

TíTULO: Unobserved Components and Time Series Econometrics

FECHA: 2015

EDITORIAL: Oxford University Press

CAPÍTULO: More is not always better: Kalman filtering in Dynamic factor models, con P. Poncela.

AUTOR: E. Hillebrand y S.J. Koopman (editores)

TíTULO: Advanced Econometrics Vol. 35, Dynamic Factor Models, 401-434

FECHA: 2016

EDITORIAL: Emerald Publishing Group

CAPÍTULO: Small versus big-data factor extraction in Dynamic factor models: An Empirical assessment, con P. Poncela.

AUTOR: Andersen, T.G. y T. Bollerslev (editores)

TÍTULO: Volatility

FECHA: 2018

EDITORIAL: Edward Elgar, The International Library of Critical Writings in Economics, 344.

CAPÍTULO: Multivariate Stochastic Variance Models, con A.C. Harvey y N. G. Shephard, reproducido de *Review of Economic Studies*, 61, 247-264, 1994.

AUTOR: Peña, D., P. Poncela y E. Ruiz (editores)

TÍTULO: Predicción con datos masivos

FECHA: 2021

EDITORIAL: FUNCAS

CAPÍTULO: Un paseo por la predicción con datos masivos, con L. Pascual.

# PUBLICACIONES, ARTÍCULOS

AUTORES: A.C. Harvey, E. Ruiz y E. Sentana

TÍTULO: Unobserved Component Time Series Models with ARCH Disturbances

REVISTA: ***Journal of Econometrics***

VOLUMEN y PÁGINAS: 52(1/2), 129-158

AÑO: 1992.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 1.011 (edición 1997), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 128

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 468

AUTORES: A.C. Harvey, E. Ruiz y N.G. Shephard

TÍTULO: Multivariate Stochastic Variance Models

REVISTA: ***Review of Economic Studies***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 61, 247-264

AÑO: 1994.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 1.421 (edición 1997), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 509

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 1857

AUTORES: E. Ruiz

TíTULO: Quasi-Maximum Likelihood Estimation of Stochastic Variance Models

REVISTA: ***Journal of Econometrics***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 63, 289-306

AÑO: 1994.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 1.011 (edición 1997), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 120

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 453

AUTORES: Peña, J.I. y E. Ruiz

TÍTULO: Stock Market Regulations and Internacional Financial Integration: the case of Spain

REVISTA: ***European Journal of Finance***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 1, 367-382

AÑO: 1995.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 2

AUTORES: Pascual, L., E. Ruiz y J. Romo.

TÍTULO: Effects of parameter estimation on prediction densities: A bootstrap approach

REVISTA: ***International Journal of Forecasting***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 17(1), 83-103

AÑO: 2001.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 0.672 (edición 2001).

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 34

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 58

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Finite sample properties of a QML estimator of Stochastic Volatility models with long memory

REVISTA: ***Economics Letters***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 70(2), 157-164

AÑO: 2001.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 0.272 (edición 2001), Q4.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 13

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 32

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: Outliers and Conditional Autoregressive Heteroscedasticity in time series

REVISTA: ***Estadística***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 53, 143-213.

AÑO: 2001.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 33

AUTORES: Ruiz, E. y L. Pascual

TÍTULO: Bootstraping financial time series

REVISTA: ***Journal of Economic Surveys***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 16, 271-300

AÑO: 2002.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.372 (edición 2002), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 40

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 117

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Modelos de memoria larga para series temporales económicas y financieras

REVISTA: **Investigaciones Económicas**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 26(3), 359-410

AÑO: 2002.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 12

AUTORES: Hernández, N., C. Pañeda y E. Ruiz

TÍTULO: Relaciones dinámicas en el mercado internacional de carne de vacuno

REVISTA: **Revista de Economía Aplicada**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 10(29), 137-149

AÑO: 2002.

AUTORES: Ruiz, E. y A. Pérez

TÍTULO: Asymmetric long memory GARCH: A reply to Hwang’s model

REVISTA: ***Economics Letters***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 78(3), 415-422

AÑO:2003.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.337 (edición 2003), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 4

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 20

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Properties of the sample autocorrelations of non-linear transformations in long memory stochastic volatility models

REVISTA: ***Journal of Financial Econometrics***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 1(3), 420-444

AÑO: 2003.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 26

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: Persistence and kurtosis in GARCH and Stochastic Volatility Models

REVISTA: ***Journal of Financial Econometrics***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 2, 319-342

AÑO: 2004.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 226

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TÍTULO: Bootstrap predictive inference for ARIMA processes

REVISTA: ***Journal of Time Series Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 25, 449-465

AÑO: 2004.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.41 (edición 2004), Q4.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 52

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 108

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TÍTULO: Estimation methods for Stochastic Volatility models: A survey

REVISTA: ***Journal of Economic Surveys***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 18, 613-649

AÑO: 2004.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 0.326 (edición 2004), Q4.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 78

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 291

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TÍTULO: Bootstrap prediction intervals for power-transformed time series

REVISTA: ***International Journal of Forecasting***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 21(2), 219-235

AÑO: 2005.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Factor de Impacto 0.753 (edición 2005), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 13

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 21

AUTORES: Rodríguez, J. y E. Ruiz

TÍTULO: A powerful test for conditional heteroscedasticity for financial time series with highly persistent volatilities

REVISTA: ***Statistica Sinica***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 15, 505-526

AÑO: 2005.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.926 (edición 2005), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 9

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 29

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TÍTULO: Unobserved component models with asymmetric conditional variances

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 50(9), 2146-2166

AÑO: 2006.

Revista listada en JCRl Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.926 (edición 2006), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 11

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 25

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TÍTULO: Bootstrap prediction for returns and volatilities in GARCH models

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 50(9), 2293-2312

AÑO: 2006.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.928 (edición 2006), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 76

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 188

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: Effects of outliers on the identification and estimation of GARCH modelsREVISTA: ***Journal of Time Series Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 28(4), 471-497.

AÑO: 2007.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.747 (edición 2007), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 51

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 121

AUTORES: Ruiz, E. y H. Veiga

TÍTULO: Modelling long-memory volatilities with leverage effect: A-LMSV versus FIEGARCH

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 52(6), 2846-2862

AÑO: 2008.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 1.126 (edición 2008), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 24

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 64

AUTORES: Rodríguez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Bootstrap Prediction Intervals in State Space Models

REVISTA: ***Journal of Time Series Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 30(2), 167-178.

AÑO: 2009.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 0.747 (edición 2009), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 25

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 64

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TÍTULO: Testing for condicional heterocedasticity in the components of inflation

REVISTA: ***Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 13.2

AÑO: 2009.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.857 (edición 2009), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 6

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 13

AUTORES: Pérez, A., E. Ruiz y Veiga, H.

TÍTULO: A note on the properties of power-transformed returns in long-memory stochastic volatility models with leverage effect

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 53(10), 3593-3600.

AÑO: 2009.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 1.228 (edición 2009), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 6

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 15

AUTORES: Pellegrini, S., E. Ruiz y A. Espasa

TÍTULO: Conditionally heterocedastic unobserved component models and their reduced form

REVISTA: ***Economics Letters***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 107(2), 88-90.

AÑO: 2010.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.449 (edición 2010), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 1

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 4

AUTORES: Pellegrini, S., E. Ruiz y A. Espasa

TÍTULO: Prediction intervals in conditionally heteroscedastic time series with stochastic components

REVISTA: ***International Journal of Forecasting***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 27, 308-319.

AÑO: 2011.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.485 (edición 2011). Q1

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 12

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 19

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Maximally autocorrelated power transformations: a closer look at the properties of stochastic volatility models

REVISTA: ***Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 16.3

AÑO: 2012.

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.511 (edición 2012). Q3

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 1

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 4

AUTORES: Rodríguez, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Bootstrap prediction mean squared errors of unobserved states based on the Kalman filter with estimated parameters

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 56, 62-74

AÑO: 2012.

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 1.304 (edición 2012), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 17

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 39

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: Estimating and forecasting GARCH volatility in the presence of outliers

REVISTA: ***Economics Letters***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 114, 86-90

AÑO: 2012

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.509 (edición 2012), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 32

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 72

AUTORES: Rodríguez, M.J. y E. Ruiz

TÍTULO: GARCH models with leverage effect: differences and similarities

REVISTA: ***Journal of Financial Econometrics***

VOLUMEN Y PAGINAS: 10(4), 637-668.

AÑO: 2012

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.976 (edición 2012), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (junio 2019): 25

No. de citaciones en Google Scholar (junio 2019): 71

AUTORES: Santos. A.A.P., F.J. Nogales, E. Ruiz y D. van Dijk

TÍTULO: Optimal portfolios with minimum capital requirements

REVISTA: ***Journal of Banking and Finance***

VOLUMEN Y PAGINAS: 36(7), 1928-1942

AÑO: 2012

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.287 (edición 2012), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 17

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 36

AUTORES: Santos, A.A.P., F.J. Nogales y E. Ruiz

TÍTULO: Comparing univariate and multivariate models to forecast portfolio Value-at-Risk.

REVISTA: ***Journal of Financial Econometrics***

VOLUMEN Y PAGINAS: 11(2), 400-441.

AÑO: 2013

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.163 (edición 2013), Q2.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 35

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 96

AUTORES: Fresoli, D., E. Ruiz y L. Pascual

TÍTULO: Bootstrap Multi-step Forecasts of Non-Gaussian VAR Models

REVISTA: ***International Journal of Forecasting***

VOLUMEN Y PAGINAS: 31(3), 834-848

AÑO: 2015

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.626 (edición 2015), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 14

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 37

AUTORES: Fresoli, D. y E. Ruiz

TÍTULO: The uncertainty of conditional returns, volatilities and correlations in DCC models

REVISTA: ***Computational Statistics & Data Analysis***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 100, 170-185

AÑO: 2016

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 1.693 (edición 2016), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 15

AUTORES: Nieto, M.R. y E. Ruiz

TÍTULO: Frontiers in VaR forecasting and backtesting

REVISTA: ***International Journal of Forecasting***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 32, 475-501

AÑO: 2016

Revista listada en JCR Science Edition (Statistics and Probability) con Factor de Impacto 2.642 (edición 2016), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 44

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 86

AUTORES: Carnero, M.A., A. Pérez y E. Ruiz

TÍTULO: Identification of asymmetric conditional heteroscedasticity in the presence of outliers

REVISTA: ***SERIEs***

VOLUMEN Y PÁGINAS: 7, 179-201

AÑO: 2016

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 0.424 (edición 2016), Q4.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (junio 2019): 9

AUTORES: Coronas, F., P. Poncela and E. Ruiz

TÍTULO: Determining the number of factors after stationary univariate transformations

REVISTA: **Empirical Economics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 53, 351-372

AÑO: 2017

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.029 (edición 2017), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 5

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 12

AUTORES: Mao, X., E. Ruiz and H. Veiga

TÍTULO: Threshold stochastic volatility models

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 33(4), 1105-1123

AÑO: 2017

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 2.186 (edición 2017), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 8

AUTORES: Trucíos, C., L. Hotta and E. Ruiz

TÍTULO: Robust bootstrap forecast densities for GARCH returns and volatilities

REVISTA: **Journal of Statistical Computation and Simulation**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 87(16), 3152-3174

AÑO: 2017

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Statistics and Probability) con Indice de Impacto 0.869 (edición 2017), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 15

AUTORES: Maezzu, J.H.G., E. Ruiz and H. Veiga

TÍTULO: Model uncertainty and the forecast accuracy of ARMA models: A survey

REVISTA: **Journal of Economic Surveys**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 32(2), 388-419

AÑO: 2018

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 2.758 (edición 2018), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 3

AUTORES: De Almeida, D., L.K. Hotta and E. Ruiz

TÍTULO: MGARCH models: Trade-off between feasibility and flexibility

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 34, 45-63

AÑO: 2018

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 3.386 (edición 2018), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 10

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 39

AUTORES: Trucíos, C., L. Hotta and E. Ruiz

TÍTULO: Dynamic conditional correlations: Implications for portfolio selection and value-at-risk

REVISTA: **Journal of Statistical Computation and Simulation**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 88(10), 1976-2000

AÑO: 2018

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Statistics and Probability) con Indice de Impacto 0.767 (edición 2018), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 12

AUTORES: González-Rivera, G., E. Ruiz and J. V. Maldonado

TÍTULO: Growth in Stress

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 35(3), 948-966

AÑO: 2019

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 2.825 (edición 2019), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 1

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 4

AUTORES: Corona, F., P. Poncela y E. Ruiz

TÍTULO: Estimating non-stationary common factors: Implications for risk sharing

REVISTA: **Computational Economics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 55, 37-60

AÑO: 2020

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.876 (edición 2020), Q3.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 14

AUTORES: Mao, X., Czellar, V., E. Ruiz y H. Veiga

TÍTULO: Asymmetric stochastic volatility models: properties and particle filter-based simulated maximum likelihood estimation

REVISTA: **Econometrics and Statistics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 13, 84-105

AÑO: 2020

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 3

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 5

AUTORES: González-Rivera, G., Y. Luo y E. Ruiz

TÍTULO: Prediction regions for interval-valued time series

REVISTA: **Journal of Applied** **Econometrics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 35(4), 373-390

AÑO: 2020

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 2.424 (edición 2020), Q2.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 2

AUTORES: Mazzeu, J.H.G., G. González-Rivera, E. Ruiz y H. Veiga

TÍTULO: A bootstrap approach for generalized autocontour testing

REVISTA: **Econometric Reviews**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 39, 971-990

AÑO: 2020

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Statistics and Probability) con Indice de Impacto 1.718 (edición 2020), Q2.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 2

AUTORES: Moura, G.V., A.A.P. Santos y E. Ruiz

TÍTULO: Comparing high-dimensional conditional covariance matrices: Implications for portfolio selection

REVISTA: **Journal of Banking and Finance**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 118, 105882

AÑO: 2020

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 3.070 (edición 2020), Q1.

No. de citaciones en ISI Web of Knowledge (julio 2021): 1

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 6

AUTORES: Poncela, P., Ruiz, E. y K. Miranda

TÍTULO: Factor extraction using Kalman filter and smoothing: This is not just another survey

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 37(4), 1399-1425.

AÑO: 2021

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 7.022 (edición 2021), Q1 (D1).

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 3

AUTORES: Maldonado, J.V. y E. Ruiz

TÍTULO: Measuring the uncertainty of principal components in Dynamic Factor models

REVISTA: **Oxford Bulletin of Economics and Statistics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 83(6), 1432-1453

AÑO: 2021

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Statistics and Probability) con Indice de Impacto 2.518 (edición 2020), Q1.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021): 1

AUTORES: Nieto, M.R. y E. Ruiz

TÍTULO: Direct versus iterated multi-period Value at Risk

REVISTA: **Journal of Economic Surveys**

VOLUMEN Y PÁGINAS:

AÑO: En prensa

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 4.237 (edición 2020), Q2.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021):

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TÍTULO: Factor extraction in Dynamic Factor Models: Kalman filter versus Principal Components

REVISTA: **Foundations and Trends in Econometrics**

VOLUMEN Y PÁGINAS:

AÑO: 2022

AUTORES: Miranda, K., P. Poncela y E. Ruiz, E.

TÍTULO: Dynamic Factor Models: does the specification matter?

REVISTA: **SERIeS**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 13, 397-428

AÑO: 2022

Revista listada en JCR Social Sciences Edition (Economics) con Indice de Impacto 1.737 (edición 2021), Q3.

No. de citaciones en Google Scholar (julio 2021):

# OTRAS PUBLICACIONES

# 7.1 Trabajos publicados sin evaluación anónima

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Comentario a “Guía para la estimación de modelos ARCH”, por A. Novales y M. Gracia-Díez.

REVISTA: **Estadística Española**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 35(132), 68-73

AÑO: 1993.

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Crítica a “Métodos Cuantitativos para el Análisis de la Coyuntura Económica”, por A. Espasa y J.R. Cancelo

REVISTA: **Estadística Española**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 35(133), 467-469

AÑO: 1993

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Modelos para series temporales heterocedásticas

REVISTA: **Cuadernos Económicos del ICE**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 56, 73-108

AÑO: 1994.

AUTORES:Harvey, A.C. y E. Ruiz

TÍTULO: Comentario sobre “Bayesian Analysis of Stochastic Volatility models”, por E. Jacquier, N.G. Polson y E. Rossi

REVISTA: **Journal of Business and Economic Statistics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 12(4), 402-403.

AÑO: 1994.

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: STAMP 5.0: Un programa para el análisis de series temporales

REVISTA: **Revista de Economía Aplicada**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 5, 175-193

AÑO: 1997

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: QML and GMM estimators of stochastic volatility models: Response to Andersen and Sorensen

REVISTA: **Journal of Econometrics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 76, 405.

AÑO: 1997

AUTORES: Espasa, A. y E. Ruiz

TÍTULO: Robert Engle y Clive Granger. Métodos modernos de análisis de series temporales

REVISTA: **Economistas**

VOLUMEN Y PÁGINAS: no. 100 extra, 382-384

AÑO: 2004

AUTORES: García-Ferrer, A., J.G. De Gooijer, P. Poncela y E. Ruiz

TÍTULO: Introduction to nonlinearities, business cycles, and forecasting

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 21, 623-808

AÑO: 2005

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Comments on “Band-limited stochastic processes in discrete and continuous time” by D.S.G. Pollock

REVISTA: **Proceedings of the 56th Session of the ISI. The Bulletin of the International Statistical Institute.**

VOLUMEN Y PÁGINAS:

AÑO: 2007

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Entrevista con Profesor Rob Engle

REVISTA: **BIAM**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 159, 64-66

AÑO: 2007

AUTORES: Ruiz, E. y H. Veiga

TÍTULO: Modelos de volatilidad estocástica: Una alternativa atractiva y factible para modelizar la evolución de la volatilidad

REVISTA: **Anales de Valladolid**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 18, 1-59

AÑO: 2008

AUTORES: Ruiz, E. y M.R. Nieto

TÍTULO: El efecto de la crisis sobre la volatilidad y el riesgo del IBEX35

REVISTA: **BIAM**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 186, 79-87

AÑO: 2010

AUTORES: E. Ruiz

TÍTULO: Estimando relaciones entre variables económicas (utilizando integrales, límites, inversión de matrices, maximización numérica y derivadas)

REVISTA: **Matematicalia**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 7(1)

AÑO: 2011

AUTORES: Ruiz, E.

TÍTULO: Entrevista con Profesor Andrew Harvey

REVISTA: **BIAM**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 200

AÑO: 2011

AUTORES: E. Ruiz y N. Crato

TÍTULO: Can we evaluate the predictability of financial markets?

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 28(1), 1-2

AÑO: 2012

AUTORES: E. Ruiz. M. Scaglione y D. Croushore

TÍTULO: Introduction to Flash Indicators

REVISTA: **International Journal of Forecasting**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 29, 642-643

AÑO: 2013

AUTORES: Bujosa Brun, M., A. de Juan Fernández, A. López López, A. Martín Arroyo, P. Poncela Blanco, E. Ruiz Ortega y R. Sánchez Mangas

TÍTULO: Antonio García Ferrer: Algo más que un profesor e investigador de talla internacional

REVISTA: **Encuentros multidisciplinares, Universidad Autónoma de Madrid**

VOLUMEN Y PÁGINAS: No. 58

AÑO: 2018

AUTORES: P. Poncela y E. Ruiz

TÍTULO: A comment on the dynamic factor model with dynamic factors

REVISTA: **Economics**

VOLUMEN Y PÁGINAS: Discussion paper no. 2020-7

AÑO: 2020

JCR impact factor (Economics edition 2018): 0.735 (Q3)

AUTORES: A. Escribano, D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: 30 Years of Cointegration and Dynamic Factor Models. Forecasting and its Future with Big Data: Editorial

REVISTA: **International Journal of Forecsating**

VOLUMEN Y PÁGINAS: 37(4)

AÑO: 2021

JCR impact factor (Economics edition 2021):

# 7.2 Documentos de trabajo.

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TÍTULO: Detecting level shifts in the presence of conditional heteroscedasticity

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO: WP 03-63(13)

ORGANISMO: IVIE

NÚMERO: WP-AD-2004-06.

AUTORES: Alva, P.K., J. Romo y E. Ruiz

TÍTULO: Modelling intra-daily volatility by functional data analysis: an empirical application to the Spanish stock market.

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO: WP 09-28

AUTORES: Rodríguez, M.J. y E. Ruiz

TÍTULO: Comparing sample and plug-in moments in asymmetric GARCH models

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO: WP 10-41

AUTORES: Mao, X., E. Ruiz and M.H. Veiga

TÍTULO: Score driven asymmetric stochastic volatility

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO: WP 14-26 (Statistics and Econometrics)

AUTORES: González-Rivera, G., V. Rodríguez-Caballero and E. Ruiz

TÍTULO: Expecting the unexpected: economic growth under stress

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Departamento de Estadística

NÚMERO: WP 21-02 (Statistics and Econometrics)

AUTORES: de Juan, A., P. Poncela, V. Rodríguez-Caballero and E. Ruiz

TÍTULO: Economic activity and climate change

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Departamento de Estadística

NÚMERO: WP 22-03 (Statistics and Econometrics)

ORGANISMO: arXiv

NÚMERO: arXiv.2206.03187v1[econ.EM]

AUTORES: Fresoli, D., P. Poncela and E. Ruiz

TÍTULO: Ignoring cross-correlated idiosyncratic components when extracting factors in dynamic factor models

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Departamento de Estadística

NÚMERO: WP 22-11 (Statistics and Econometrics)

# 8 OTROS TRABAJOS DE INVESTIGACIÓN

· Tesina de licenciatura dirigida por M.C. Gallastegui con el título: “Análisis del consumo de energía eléctrica en la Comunidad Autónoma Vasca”, Calificación: SOBRESALIENTE.

· Ayudante de investigación ocasional, Dpto. de Estadística, London School of Economics and Political Science, 1988-1991.

· Miembro del grupo de investigación “Non-linear and complex systems analysis” del Nacional Center for Econometric Research (NCER), Australia ([http://www.ncer.edu.au](http://ncer.edu.au)) liderado por Rodney Wolf (QUT).

· Miembro del grupo de investigación “Statistical Signal Extraction and Filtering” organizado por el grupo “Computing & Statistics” del European Consortium for Informatics and Mathematics (ERCIM) (<http://www.ercim.org/activity/workgroup.html>) y liderado por Tommaso Proietti y Stephen Pollock.

# PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN SUBVENCIONADOS

* 1. **Proyectos como investigadora principal**

1. TÍTULO DEL PROYECTO: Econometric inference using simulation techniques

ENTIDAD FINANCIADORA: Unión Europea dentro del programa “Human Capital & Mobility Project”

NÚMERO DE REFERENCIA: ERB CHR XCT 94 0514

DURACIÓN: 1995-1998

CANTIDAD: 380.000 ecus

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

2. TÍTULO DEL PROYECTO: Nuevos modelos teóricos para la volatilidad de series temporales

ENTIDAD FINANCIADORA: DGICYT, Ministerio de Educación y Ciencia

NÚMERO DE REFERENCIA: PB92-0244

DURACIÓN: 1993-1996

CANTIDAD: 2.000.000 Ptas.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

3. TÍTULO DEL PROYECTO: Incertidumbre en la construcción de modelos econométricos y metodologías de predicción para series macroeconómicas y financieras

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Educación y Ciencia

NÚMERO DE REFERENCIA: SEJ2006-03919

DURACIÓN: 2006-2009

CANTIDAD: 97.388 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

4. TÍTULO DEL PROYECTO: Predictability of Financial Markets

ENTIDAD FINANCIADORA: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO DE REFERENCIA: 2009/00287/001

DURACIÓN: 2009

CANTIDAD: 2.500 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

5. TÍTULO DEL PROYECTO: La incertidumbre en la predicción macroeconómica y financiera: técnicas bootstrap.

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Innovación y Ciencia

NÚMERO DE REFERENCIA: ECO2009-08100 (subprograma ECON)

DURACIÓN: 2010-2012

CANTIDAD: 80.000 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

6. TÍTULO DEL PROYECTO: Modelos econométricos para la incertidumbre: Nuevos desarrollos

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Economía y Competitividad

NÚMERO DE REFERENCIA: ECO2012-32401

DURACIÓN: 2013-2015

CANTIDAD: 35.000 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

7. TÍTULO DEL PROYECTO: First Meeting on Time Series and Computation

ENTIDAD FINANCIADORA: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO DE REFERENCIA: 2013/00285/001

DURACIÓN: 2013

CANTIDAD: 500 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

8. TÍTULO DEL PROYECTO: Indicadores económicos: Predicción con incertidumbre e inestabilidad

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Economía y Competitividad

NÚMERO DE REFERENCIA: ECO2015-70331-C2-2-R

DURACIÓN: 2016-2018

CANTIDAD: 23.500 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

9. TÍTULO DEL PROYECTO: Predicción de series temporales no estacionarias de grandes dimensiones

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Economía y Competitividad

NÚMERO DE REFERENCIA: PID2019-108079GB-C21

DURACIÓN: 2020-2023 (Fecha de inicio 1/6/2020)

CANTIDAD: 30.008 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

10. TÍTULO DEL PROYECTO: Climate change and economic challenges for the Spanish society

ENTIDAD FINANCIADORA: La Caixa Banking Foundation

NÚMERO DE REFERENCIA: SR20-00098

DURACIÓN: 2021-2022

CANTIDAD: 100.000 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Ruiz, E.

* 1. **Proyectos como miembro del equipo investigador**

1. TÍTULO DEL PROYECTO: Estimation and diagnostic checking of unobserved component models

ENTIDAD FINANCIADORA: Economic & Social Research Council (ESRC)

NÚMERO DE REFERENCIA: R000233574

DURACIÓN: 1992-1994

CANTIDAD:

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Harvey, A.C.

2. TÍTULO DEL PROYECTO: Análisis macroeconómico y diagnóstico para la política económica a partir del estudio y modelización de indicadores de alta frecuencia y macromagnitudes trimestrales

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Enseñanza Superior, Ministerio de Educación y Cultura

NÚMERO DE REFERENCIA: PB95-0299

DURACIÓN: 1996-1999

CANTIDAD: 12.000.000 Ptas.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Espasa, A.

3. TÍTULO DEL PROYECTO: Asimetría, persistencia y volatilidad estocástica en el análisis de series temporales

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Enseñanza Superior e Investigación Científica, Ministerio de Educación y Cultura

NÚMERO DE REFERENCIA: PB98-0026

DURACIÓN: 1999-2002

CANTIDAD: 3.375.000 Ptas.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Juan José Dolado Lobregad

4. TÍTULO DEL PROYECTO: Metodología econométrica para la modelización y predicción de series macroeconómicas y financieras

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Investigación, Ministerio de Ciencia y Tecnología

NÚMERO DE REFERENCIA: BEC2002-03720

DURACIÓN: 2002-2005

CANTIDAD: 77.520 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Antoni Espasa Terrades

5. TÍTULO DEL PROYECTO: Microstructure of financial markets in Europe

ENTIDAD FINANCIADORA: Unión Europea dentro del programa “Research Training Networks”

NÚMERO DE REFERENCIA: HPRN-CT-2002-00232

DURACIÓN: 2002-2006

CANTIDAD:

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Álvaro Escribano

6. TÍTULO DEL PROYECTO: Seminario internacional sobre “No linealidad, ciclos económicos y predicción (Nonlinearities, Business cycles and forecasting)”

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Investigación, Ministerio de Ciencia y Tecnología

NÚMERO DE REFERENCIA: Acción Especial SEC2002-10511-E

DURACIÓN: 2003

CANTIDAD FINANCIADA: 12.000 €.

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Antonio García Ferrer

7. TÍTULO DEL PROYECTO: Modelos desagregados para el nivel y la incertidumbre de series macroeconómicas

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Universidades e Investigación, Comunidad de Madrid

NÚMERO DE REFERENCIA: 06/HSE/0155/2004

DURACIÓN: 2005

CANTIDAD FINANCIADA: 7.475 €

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Antoni Espasa Terrades

8. TÍTULO DEL PROYECTO: XXVI Internacional Symposium of Forecasting

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Investigación

NÚMERO DE REFERENCIA: SEJ2004-2119-E

DURACIÓN: 2006

CANTIDAD FINANCIADA: 15000 €

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Antonio García-Ferrer

9. TÍTULO DEL PROYECTO: Modelización econométrica y aplicación empírica de los indicadores y sistemas de alarma de crisis bancarias

ENTIDAD FINANCIADORA: Universidad de Oviedo

NÚMERO DE REFERENCIA: MB-05-533

DURACIÓN: 2005, prorrogado a 2006

CANTIDAD FINANCIADA: 4500 €

INVESTIGADOR PRINCIPAL: José Luis Pérez Rivero

10. TÍTULO DEL PROYECTO: Grupo de Predicción y Análisis Macroeconómico y Financiero

ENTIDAD FINANCIADORA: Universidad Carlos III de Madrid

NÚMERO DE REFERENCIA: UC3M-ECO-05-013

DURACIÓN: 2006

CANTIDAD FINANCIADA: 7000 €

INVESTIGADOR PRINCIPAL: Antoni Espasa Terrades

# 

# 10 COMUNICACIONES Y PONENCIAS PRESENTADAS A CONGRESOS

# 10.1 Congresos Internacionales

CONGRESO:International Conference on ARCH models and applications to financial and monetary econometrics

TÍTULO: Unobserved component models with ARCH disturbances

AUTORES: Harvey, A.C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: París, 1990

CONGRESO:6th World Congress of the Econometric Society

TÍTULO: Unobserved component models with ARCH disturbances

AUTORES: Harvey, A.C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Barcelona, 1990

CONGRESO:ASSET Meeting

TÍTULO: Unobserved component models with ARCH disturbances

AUTORES: Harvey, A.C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Bilbao, 1990

CONGRESO:European Conference of the Econom(etr)ics Community (EC2)

TÍTULO: Multivariate stochastic variance models

AUTORES: Harvey, A.C., E. Ruiz y N.G. Shephard

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Rotterdam, 1991

CONGRESO:ASSET Meeting

TÍTULO: Modelling volatility: some alternatives to ARCH

AUTORES: Harvey, A.C., E. Ruiz y N.G. Shephard

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Atenas, 1991

CONGRESO:ESRC Econometric Study Group Conference

TÍTULO: Quasi-Maximum likelihood estimation of stochastic variance models

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Bristol, 1992

CONGRESO:ASSET Meeting

TÍTULO: Quasi-Maximum likelihood estimation of stochastic variance models

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Toulouse, 1992

CONGRESO:Econometric Society European Meeting

TÍTULO: Stochastic volatility versus autoregressive conditional heteroscedasticity

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Uppsala, 1993

CONGRESO:Financial Markets Dynamics and Forecasting

TÍTULO: Stochastic volatility versus autoregressive conditional heteroscedasticity

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: París, 1993.

CONGRESO:ASSET Meeting

TÍTULO: Stochastic volatility versus autoregressive conditional heteroscedasticity

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Barcelona, 1993

CONGRESO:Forecasting Financial Markets: New Advances for exchange Rates, Interest Rates and Stock Prices

TÍTULO: Stock Market regulations and international financial integration: the case of Spain

AUTORES: Peña, J.I. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Londres, 1994

CONGRESO:Winter Meeting of the Econometric Society

TÍTULO: Using Stochastic Volatility models to model heteroscedastic time series

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Viena, 1994

CONGRESO:Workshop on Machine Learning, Forecasting and Optimization

TÍTULO: Using Stochastic Volatility models to model heteroscedastic time series

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Madrid, 1996

CONGRESO:15th International Workshop on Statistical Modelling

TÍTULO: Finite sample properties of a QML estimator of SV models with long memory

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Bilbao, 2000

CONGRESO:ASSET Meeting

TÍTULO: Finite sample properties of a QML estimator of SV models with long memory

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Alicante, 1998

CONGRESO:EC2 Meeting

TÍTULO: Bootstrap procedures in ARIMA models

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Estocolmo, 1998

CONGRESO:EC2 Meeting

TÍTULO: Finite Sample Properties of a QML estimator of Stochastic Volatility models with long memory

AUTORES: Pérez y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Poster

LUGAR Y FECHA: Madrid, 1999

CONGRESO:20th International Symposium on Forecasting

TÍTULO: Properties of a QML estimator of Stochastic Volatility models with long memory

AUTORES: Pérez y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Lisboa, 2000

CONGRESO:International Conference on the Econometrics of Financial Markets

TÍTULO: Properties of a QML estimator of Stochastic Volatility models with long memory

AUTORES: Pérez y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Delphi, 2001

CONGRESO:Fith Time Series Workshop of Arrabida

TÍTULO: Bootstrap prediction intervals in ARIMA models

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Arrabida (Portugal), 2001

CONGRESO:International Conference on Modelling Volatility

TÍTULO: Forecasting returns and volatilities in GARCH processes using the bootstrap

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Perth, 2001

CONGRESO:21st International Symposium of Forecasting

TÍTULO: Forecasting returns and volatilities in GARCH processes using the bootstrap

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Dublin, 2002

CONGRESO:Econometric Society of Australasia Meeting

TÍTULO: Properties of the sample autocorrelations of non-linear transformations in long-memory stochastic volatility models

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Brisbane (Australia), 2002

CONGRESO:22nd International Symposium of Forecasting

TÍTULO: Properties of the sample autocorrelations of non-linear transformations in long-memory stochastic volatility models

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Mérida, MEXICO, 2003

CONGRESO:International Workshop Recent Advances in Time Series Analysis

TÍTULO: A robust test for conditional heteroscedasticity

AUTORES: Rodríguez, J. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Poster

LUGAR Y FECHA: Protaras (Chipre), Junio 2004.

CONGRESO:23rd International Symposium of Forecasting

TÍTULO: A robust test for conditional heteroscedasticity

AUTORES: Rodríguez, J. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Sydney, 2004.

CONGRESO:Econometric Society Australian Meeting

TÍTULO: Effects of level outliers on the identification and estimation of GARCH models

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Melbourne, 2004.

CONGRESO:13th Annual Symposium of the Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics

TÍTULO: Stochastic Volatility models and the Taylor effect

AUTORES: Mora-Galán, A., A. Pérez y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Londres, 2005

CONGRESO:25th International Symposium of Forecasting

TÍTULO: The uncertainty of inflation: empirical evidence

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: San Antonio, Texas, 2005

CONGRESO:3rd World Conference on Computational Statistics & Data Analysis

TÍTULO: Using auxiliary residuals to detect conditional heteroscedasticity in inflation

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Limassol, Chipre, 2005

CONGRESO:International Workshop on Computational and Financial Econometrics

TÍTULO: Stochastic Volatility and the Taylor effect

AUTORES: Mora-Galán, A., A. Pérez y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Ginebra (Suiza), 2006

CONGRESO:International Symposium on Business and Industrial Statistics

TÍTULO: Outliers in GARCH models

AUTORES: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Islas Azores (Portugal), 2007.

CONGRESO:56th Session of the International Statistical Institute (ISI)

TÍTULO: Stochastic volatility models and the Taylor effect

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Lisboa, 2007.

CONGRESO: European Meeting of theEconometric Society

TÍTULO: Conditionally heteroscedastic unobserved component models

AUTORES: Pellegrini, S., E. Ruiz y A. Espasa

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Budapest, 2007.

CONGRESO: European Meeting of theEconometric Society

TÍTULO: Estimating underlying volatility in the presence of outliers

AUTORES: Carnero, A., D. Peña y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Budapest, 2007.

CONGRESO: 2nd International Workshop on Computational and Financial Econometrics

TÍTULO: Stochastic Volatility Models and the Taylor effect

AUTORES: Pérez A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Neuchâtel (Suiza), Junio 2008.

CONGRESO: 29th International Symposium on Forecasting

TÍTULO: Bootstrap prediction in unobserved component models

AUTORES: Rodríguez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Hong Kong (China), Junio 2009.

CONGRESO: 3rd International Conference on Computational and Financial Econometrics

TÍTULO:

AUTORES: Alva, P.K., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Limassol (Chipre), Octubre 2009.

CONGRESO: 3rd International Conference on Computational and Financial Econometrics

TÍTULO:

AUTORES: Nieto, M.R. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Limassol (Chipre), Octubre 2009.

CONGRESO: 3rd International Conference on Computational and Financial Econometrics

TÍTULO:

AUTORES: Rodríguez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Limassol (Chipre), Octubre 2009.

CONGRESO: 30TH INTERNATIONAL SYMPOSIUM FORECASTING 2010

TÍTULO: Bootstrap methods in Financial Econometrics

AUTORES: Ruiz, E., a. Carnero and D.Peña

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: San Diego (EEUU), Junio 2010.

CONGRESO: COMPSTAT 2010

TÍTULO: Bootstrap methods in Financial Econometrics

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Sesión invitada

LUGAR Y FECHA: París (Francia), Agosto 2010.

CONGRESO: Computational and Financial Econometrics 2010

TÍTULO: Outliers in GARCH models

AUTORES: Ruiz, E., M.A. Carnero y D. Peña

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Sesión invitada

LUGAR Y FECHA: Londres (Inglaterra), Diciembre 2010.

CONGRESO: 31TH INTERNATIONAL SYMPOSIUM FORECASTING 2011

TÍTULO: Bootstrap forecast of multivariate VAR models

AUTORES: Ruiz, E. y D. Friesoli

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Praga (República Checa), Junio 2011

CONGRESO: Computational and Financial Econometrics 2011

TÍTULO: The Kalman filter and Dynamic factor models

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Sesión invitada

LUGAR Y FECHA: Londres (Inglaterra), Diciembre 2011

CONGRESO: Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics 20th Annual Symposium

TÍTULO: On the issue of how many variables to use when estimating common factors using the Kalman filter

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Estambul (Turquía), Abril 2012

CONGRESO: Conference in honour of Andrew Harvey

TÍTULO: On the issue of how many variables to use when estimating common factors using the Kalman filter

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Oxford (Reino Unido), Junio 2012

CONGRESO: 6th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2012) and 5th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing Statistics (ERCIM 2012)

TÍTULO: Bootstrapping prediction intervals

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Conferencia Plenaria**

LUGAR Y FECHA: Oviedo (España), Diciembre 2012

CONGRESO: 33TH INTERNATIONAL SYMPOSIUM FORECASTING 2013

TÍTULO:

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Seúl (Corea del Sur), Junio 2013

CONGRESO: Instituto de Estadística de Portugal

TÍTULO:

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Conferencia Plenaria**

LUGAR Y FECHA: Aveiro (Portugal), Noviembre 2013

CONGRESO: 7th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2013)

TÍTULO: Bootstrap for DCC models

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Londres (Reino Unido), Diciembre 2013

CONGRESO: Conference on Indirect Estimation Methods in Finance and Economics

TÍTULO: One for all: nesting asymmetric stochastic volatility models

AUTORES: X. Mao, M.H. Veiga y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Konstanz (Alemania), 30-31 Mayo, 2014

CONGRESO: International Symposium of Forecasting

TÍTULO:

AUTORES: Poncela, P. y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Rotterdam (Holanda), 29-2 Julio 2014

CONGRESO: Conference on modelling macroeconomic and financial time series

TÍTULO: One for all: nesting asymmetric stochastic volatility models

AUTORES: X. Mao, M.H. Veiga y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Loughborough University (Reino Unido), 20-21 Julio 2014

CONGRESO: 16th Advances in Econometrics Conference

TÍTULO: Dimensionality: curse or blessing? An empirical assessment when estimating factors in DFM

AUTORES: P. Poncela y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral

LUGAR Y FECHA: CREATES, Aarhus University (Dinamarca), 15-16 Noviembre 2014

CONGRESO: 48th Italian Statistical Society Meeting

TÍTULO: Asymmetric Stochastic Volatility Models: Properties and estimation

AUTORES: V. Czellar, X. Mao, Ruiz, E. y M.H. Veiga

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral

LUGAR Y FECHA: Salerno (Italia), Junio 2016

CONGRESO: International Symposium of Forecasting

TÍTULO:

AUTORES: C. Trucíos, L. Hotta y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral

LUGAR Y FECHA: Santander, Junio 2016

CONGRESO: Computational and Financial Econometrics

TÍTULO: Measuring uncertainty of principal components in dynamic factor models

AUTORES: E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral y organización de sesión invitada ”One-step-ahead in Dynamic Factor Models” con la participación de Joerg Breitung, Marc Hallin y Gabriel Perez-Quiros

LUGAR Y FECHA: Sevilla, Diciembre 2016

CONGRESO: International Panel data Conference

TÍTULO: Estimating non-stationary common factors: implications for risk sharing

AUTORES: Coronas, F., Poncela, P. y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Tesalónica (Grecia), Julio 2017

CONGRESO: Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance

TÍTULO: Testing for VIX forecast densities: A Generalized Autocontour approach

AUTORES: Ruiz, E., J. Maezzu, G. González-Rivera y M.H. Veiga

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia (sesión invitada)

LUGAR Y FECHA: Madrid (España), 4-6 abril 2018

CONGRESO: International Symposium of Forecasting

TÍTULO: VaR Uncertainty

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Tesalónica (Grecia), Junio 2019

CONGRESO: International Symposium of Forecasting

TÍTULO:

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Conferencia Plenaria**

LUGAR Y FECHA: Río de Janeiro (Brasil), online for Covid19, 26-28 Octubre 2020

CONGRESO: Coloquio Virtual Asociación Mexicana de Estadística

TÍTULO: Factor extraction using Kalman filter and smoothing

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Conferencia Plenaria**

LUGAR Y FECHA: México DF (México), online for Covid19, 10-11 Septiembre 2020 <https://itam.zoom.us/rec/share/TkrTa4-b8x-_7ZFAFWErky3Jmeb2Mn5yBM8TznYzCX6K72VvzUoM_54LOSElNW1v.-OYjA5ZB7YhsKihk>

CONGRESO:2020 Annual Conference of the German Statistical Society

TÍTULO:

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Conferencia Plenaria**

LUGAR Y FECHA: Dresden (Alemania), 15-18 Septiembre 2020. Cancelado por COVID-19. Celebrado on-line Septiembre 2021.

CONGRESO:11th RCEA Money, Macro & Finance Conference

TÍTULO: Expecting the unexpected: Growth under stress

AUTORES: Ruiz, E., G. González-Rivera y V. Rodríguez-Caballero.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia**

LUGAR Y FECHA: On-line 27-28 julio 2021.

CONGRESO: 69th International Symposium of Forecasters

TÍTULO: Modelling and forecasting intervals of minimun/maximum temperature in the Iberian Peninsula

AUTORES: Ruiz, E., G. González-Rivera y V. Rodríguez-Caballero.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia**

LUGAR Y FECHA: Oxford (Reino Unido) 10-14 julio 2022

CONGRESO: Rome-Waseda Time Series Symposium

TÍTULO: Modelling and forecasting intervals of minimun/maximum temperature in the Iberian Peninsula

AUTORES: Ruiz, E., G. González-Rivera y V. Rodríguez-Caballero.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia**

LUGAR Y FECHA: Rome, 5-7 octubre 2022.

CONGRESO: Bologna-Waseda Time Series Workshop

TÍTULO: Economic activity and emissions in Spain

AUTORES: Ruiz, E., P. Poncela y A. de Juan.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia**

LUGAR Y FECHA: Bolonia (Italia), 7-10 octubre 2022

CONGRESO: 16th International Conference, Computational and Financial Econometrics (CFE 2022)

TÍTULO: Modelling and forecasting intervals of minimum/maximum temperature in the Iberian Peninsula

AUTORES: Ruiz, E., V. Rodríguez-Caballero y G. González-Rivera

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia en sesión invitada**

LUGAR Y FECHA: Londres (Reino Unido), 17-19 diciembre 2022.

CONGRESO: 10th Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics

TÍTULO: Ignoring cross-correlated idiosyncratic components when extracting factors in dynamic factor models

AUTORES: D. Fresoli, P. Poncela y Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Ponencia**

LUGAR Y FECHA: Cagliari (Italia), 26-28 mayo 2023.

CONGRESO: Quantitative Finance and Financial Econometrics (QFFE) International Conference 2023

TÍTULO: The Exchange rates factor structure: global and intermittent components

AUTORES: Ruiz, E., M. Caporin y V. Rodríguez-Caballero

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Guest speaker**

LUGAR Y FECHA: Marsella (Francia), 8-9 junio 2023.

CONGRESO: 8th Annual Conference of the Society for Economic Measurement

TÍTULO: Ignoring cross-correlated idiosyncratic components when extracting factors in dynamic factor models

AUTORES: Fresoli, D., P. Poncela y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Invited session**

LUGAR Y FECHA: Milán (Italia), 29 junio-1 julio 2023.

CONGRESO: SNDE Symposium 2024

TÍTULO:

AUTORES: E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: **Sesión Plenaria**

LUGAR Y FECHA: University of Padova (Italia), 21-22 marzo 2024.

# 10.2 Congresos Nacionales

CONGRESO:XVI Simposio de Análisis Económico

TÍTULO: Modelling volatility: Some alternatives to ARCH

AUTORES: Harvey, A.C., E. Ruiz y N. Shephard

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Barcelona, 1991.

CONGRESO:XVII Simposio de Análisis Económico

TÍTULO: Quasi-maximum likelihood estimation of stochastic variance models

AUTORES: Ruiz, E.

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Barcelona, 1992.

CONGRESO:I Jornadas de Economía Financiera

TÍTULO: Modelling Spanish stock market international relationships

AUTORES: Peña. J.I. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Bilbao, 1993.

CONGRESO:XXIV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

TÍTULO: Bootstrapping ARIMA models

AUTORES: Pascual, L., J. Romo y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Almería, 1998.

CONGRESO:XXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

TÍTULO: Propiedades en muestras finitas de un estimador PMV para el modelo de volatilidad estocástica con memoria larga

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Vigo, 2000.

CONGRESO:XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

TÍTULO: Modelos de componentes inobservables con varianzas condicionales asimétricas

AUTORES: Broto, C. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Ubeda, 2000

CONGRESO:XXIX Simposio de Análisis Económico

TÍTULO: Stochastic Volatility models and the Taylor effect

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Pamplona, 2004

CONGRESO:XXX Simposio de Análisis Económico

TÍTULO: Asymmetric Condicional Heteroscedastic models

AUTORES: Rodríguez, M.J. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Murcia, 2005

CONGRESO:XXXIII Simposio de Análisis Económico

TÍTULO: Taylor effect

AUTORES: Pérez, A. y E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, 2008

CONGRESO: 49 Simposio de la Spanish Economic Association

TÍTULO: Asymmetric stochastic volatility models: properties and ABC filter-based maximum likelihood estimation

AUTORES: E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral

LUGAR Y FECHA: Bilbao, Diciembre 2016

CONGRESO: 42 Simposio de la Spanish Economic Association

TÍTULO: Accurate subsampling intervals for principal component factors

AUTORES: E. Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia oral

LUGAR Y FECHA: Barcelona, Diciembre 2017

# 10.3 Comentarios de ponencias

CONGRESO: I Jornadas de Economía Financiera

TÍTULO DEL ARTÍCULO COMENTADO: Sobre la estimación de las primas por plazo dentro de la estructura temporal de tipos de interés

AUTOR: R. Flores

LUGAR y FECHA: Bilbao, 1993.

CONGRESO: CIRANO-CRDE Conference on Stochastic Volatility

TÍTULO DEL ARTÍCULO COMENTADO: Priors and models for multivariate stochastic volatility

AUTOR: Jacquier, E., N.G. Polson y P. Rossi

LUGAR Y FECHA: Montreal, 1994.

CONGRESO: II Jornadas de Economía Financiera

TÍTULO: ¿Se ha incrementado el riesgo de cambio en el S.M.E. después de la introducción de una mayor amplitud en las bandas de fluctuación?

AUTOR: M. Pérez-Jurado, J. Ayuso y F. Restoy

LUGAR Y FECHA: Bilbao, 1995.

CONGRESO: 56th Session of the International Statistical Institute (ISI)

TÍTULO: Band-limited stochastic processes in discrete and continuous time

AUTOR: D.S.G. Pollock

LUGAR Y FECHA: Lisboa, 2007.

# 10.4 Workshops

TÍTULO DEL WORKSHOP:Workshop on Nonparametric, semiparametric and Resampling Methods in Honour of P. Robinson

ORGANISMO: Dpto. de Estadística y Econometría, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO DE LA PONENCIA: Stochastic volatility versus ARCH

AUTOR: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Madrid, 2000.

TÍTULO DEL WORKSHOP:Meeting on Forecasting Methods

ORGANISMO: Ecole Normale Superieure de Cachan

AUTOR: Rodríguez, J. y E. Ruiz

TÍTULO DE LA PONENCIA: A robust test for conditional heteroscedasticity

LUGAR Y FECHA: Paris, 2005

TÍTULO DEL WORKSHOP:Workshop Volatility Day

ORGANISMO: Dpto. de Economía, Stocokholm School of Economics

TÍTULO DE LA PONENCIA: Estimating volatility in the presence of outliers: detection versus robust procedures

AUTOR: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Estocolmo, Noviembre 2006

TÍTULO DEL WORKSHOP:Workshop on Robustness and Statistical Inference. In honour of Victor Yohai

ORGANISMO: Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO DE LA PONENCIA: Outliers in GARCH models

AUTOR: Carnero, M.A., D. Peña y E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Madrid, Octubre 2006

TÍTULO DEL WORKSHOP:Workshop on Financial Time Series

ORGANISMO: CIM (Centro International de Matematica) y CRM (Centre de Recerca Matematica)

TÍTULO DE LA PONENCIA: Bootstrap forecast in conditionally heteroscedastic unobserved component models

AUTOR: Rodríguez, A. y E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Coimbra (Portugal), Junio 2008

TÍTULO DEL WORKSHOP:Workshop on Unobserved Component Models and Applications to Electricity Markets

ORGANISMO: Escuela Técnica Superior de Ingenieros Industriales, Universidad Politécnica de Madrid

TÍTULO DE LA PONENCIA: Bootstrap forecast in State Space models

AUTOR: Rodríguez, A. y E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Madrid, Noviembre 2008

TÍTULO DEL WORKSHOP:I Jornadas de docencia en Econometría

ORGANISMO: Universidad de Granada

TÍTULO DE LA PONENCIA: Mesa redonda sobre la situación actual y futuro de la enseñanza en Econometría

AUTOR: E. Ruiz

LUGAR Y FECHA: Granada, Julio 2009

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop on Modelling and Numerical methods in Quantitative Finance

ORGANISMO: Universidad de A Coruña

TÍTULO: Bootstrap methods in Financial Econometrics

AUTORES: Ruiz, E.

LUGAR Y FECHA: La Coruña, Octubre 2009.

TÍTULO DEL WORKSHOP: It Workshop on Time Series

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: Bootstrap PMSE of unobserved components

AUTORES: Ruiz, E. and A. Rodríguez

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2011.

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: On the issue of how many variables to use when estimating common factors using the Kalman filter

AUTORES: Ruiz, E. y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2012

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: Determining the number of factors after univariate stationary transformations

AUTORES: Corona, F., E. Ruiz y P. Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2016

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in New Developments in Econometrics and Time Series

ORGANISMO: Instituto de Big Data, Universidad Carlos III de Madrid

TÍTULO: A bootstrap approach for Generalized autocontour testing

AUTORES: J. Gonzalves, G. Gónzalez-Rivera, E. Ruiz y M.H. Veiga

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Getafe, Octubre 2016

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO:

AUTORES:

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2017

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in New Developments in Econometrics and Time Series

ORGANISMO: University of Rome

TÍTULO:

AUTORES:

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Roma, noviembre 2017

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: GiS

AUTORES: Gloria González-Rivera, Javier Maldonado y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2018

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Symbolic Data Analysis

ORGANISMO: Polytechnic Institute of Viana do Castelo

TÍTULO: Prediction regions for interval-valued time series

AUTORES: Gloria González-Rivera, Yun Luo y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Viana do Castelo (Portugal), octubre 2018

TÍTULO DEL WORKSHOP: 30 years of cointegration and its future with big data

ORGANISMO: FUNCAS

TÍTULO: Round Table

AUTORES: Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Participación invitada

LUGAR Y FECHA: Madrid, febrero 2019

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: Prediction regions for interval-valued time series

AUTORES: Gloria González-Rivera, Yun Luo y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, Abril 2019

TÍTULO DEL WORKSHOP: 2nd Italian Workshop of Econometrics and Empirical Economics: “Time Series models: Theory and Applications”, IWEEE2020

ORGANISMO: Universidad Ca’Foscai

TÍTULO: Prediction regions for interval-valued time series

AUTORES: Gloria González-Rivera, Yun Luo y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Venecia (Italia), Enero 2020

TÍTULO DEL WORKSHOP: Workshop in Time Series Econometrics

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

TÍTULO: Comparing forecasts of high dimensional conditional covariance matrices: Implications for portfolio selection

AUTORES: A. Santos, G. Moura y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Zaragoza, 12-13 Marzo 2020 (cancelado por COVID19)

TÍTULO DEL WORKSHOP: Economic forecasting in times of Covid-19, 26th IIF Workshop

ORGANISMO: American University

TÍTULO: Growth in stress: measuring macroeconomic risk in times of global pandemic

AUTORES: G. González-Rivera, Javier Maldonado y Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: 6-7 July 2020 (online)

TÍTULO DEL WORKSHOP: Jornada de predicción con datos masivos

ORGANISMO: Funcas

TÍTULO: Un paseo por la predicción con datos masivos

AUTORES: Esther Ruiz y Lorenzo Pascual

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: 8 octubre 2020 (online)

TÍTULO DEL WORKSHOP: 11th ECB Conference on Forecasting Techniques

ORGANISMO: European Central Bank

TÍTULO: Expecting the unexpected: Economic growth under stress

AUTORES: Esther Ruiz, Gloria González-Rivera y Vladimir Rodríguez-Caballero

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: 15 junio 2021 (online)

TÍTULO DEL WORKSHOP: 7th RCEA Time Series Workshop

ORGANISMO: University of Milano-Bicocca ()

TÍTULO: Expecting the unexpected: Economic growth under stress

AUTORES: Esther Ruiz, Gloria González-Rivera y Vladimir Rodríguez-Caballero

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: 25 junio 2021 (online)

TÍTULO DEL WORKSHOP: 3rd Italian Workshop of Econometrics and Empirical Economics. High-dimensional and multivariate econometrics: Theory and Practice

ORGANISMO: University of Bologna

TÍTULO: Dynamic factor models: Does the specification matter?

AUTORES: Esther Ruiz, Karen Miranda y Pilar Poncela

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: 21 enero 2022

TÍTULO DEL WORKSHOP: Modern research topics in time series econometrics

ORGANISMO: ISEG, University of Lisbon

TÍTULO: Uncertainty in DFMs

AUTORES: Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia

LUGAR Y FECHA: Lisbon, 11 marzo 2022

TÍTULO DEL WORKSHOP: New Trends and Developments in Econometrics

ORGANISMO: Bank of Portugal

TÍTULO: Expecting the unexpected: Economic growth under stress

AUTORES: Esther Ruiz, Gloria González-Rivera, Vladimir Rodríguez-Caballero

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Ponta Delgada (Azores), 1 julio 2022

TÍTULO DEL WORKSHOP: IWH Workshop on Forecasting in Times of Strucutral Change and Uncertainty

ORGANISMO:

TÍTULO:

AUTORES: Esther Ruiz

TIPO DE PARTICIPACIÓN: Ponencia invitada

LUGAR Y FECHA: Halle (Alemania), 16-17 noviembre 2023

# CURSOS Y SEMINARIOS IMPARTIDOS

# 10.1 Cursos

· Curso de doctorado sobre temas de Econometría: “La utilización del filtro de Kalman en economía”, Departamento de Análisis Económico de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universitat de València, Marzo 1993.

· Curso Métodos Cuantitativos para el Análisis de la Coyuntura Económica, dirigido por el profesor Antoni Espasa, Escuela de Economía, Colegio de Economistas de Madrid, 1993-1994.

· Participación en el curso de especialización “Técnicas de Predicción en la empresa” dirigido por el profesor Antoni Espasa, Fundación Universidad Carlos III, Octubre 1994, Junio 1995, Noviembre 1995 y Junio 1996.

· Curso de doctorado sobre temas de Econometría: “Modelo de componentes inobservables: modelos estructurales”, Departamento de Análisis Económico de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universitat de València, Febrero 1994.

· Profesora del curso “Stochastic Volatility” del doctorado en finanzas, Universidad de Neuchatel (Suiza), Noviembre 1995.

· Colaborador en enseñanzas de Econometría de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Navarra, 1995-1997.

· Profesora de curso de doctorado, Universidad de Oviedo, 1996-1998.

· Profesora de curso de doctorado, Universidad de la Laguna, 1997-1998.

· Curso de Métodos Cuantitativos para la Investigación Social, Centro de Estudios Sociales, Fundación Juan March, 1998-2007.

· 8th ERS-IASC Summer School on Statistical Models and Financial Series, Barcelona, Julio 2005.

· Curso de licenciatura “Introductory Time Series”, Ecole Normale Superieure de Cachan, París, Septiembre 2005.

· Curso “Series Temporales” de la IV Escuela de Métodos de Análisis Sociopolítico de la Universidad de Salamanca, Junio 2006, Julio 2007, Julio 2008.

· Curso “An Introduction to Stochastic Volatility”, Dipartimento di Scienze Economiche, Università Ca’Foscari di Venezia, Noviembre 2007.

· Curso “Stochastic Volatility”, Universidad Politécnica de Cataluña, Julio 2008.

· Curso “Análisis Estadístico de Series Temporales” (20 horas), Centro de Investigaciones Sociológicas (CIS), Septiembre 2013.

# 10.2 Seminarios

Dpto. de Econometría, **Universidad del País Vasco**, Bilbao, 1990, 1996, 2001; Dpto. de Economía, **Universidad Carlos III de Madrid**, Madrid, 1990; Capital Markets Group, **London School of Economics**, Londres, 1991; Seminario conjunto de Estadística y Econometría, **London School of Economics,** Londres, 1991; Dpto. de Economía, **Universidad Pompeu Fabra**, Barcelona, 1992; Seminario de Economía, **Banco de España,** Madrid, 1992; Dpto. de Fundamentos del Análisis Económico, **Universidad de Alicante,** Alicante 1993, 1996, 2004; Seminario conjunto de los Dptos. de Fundamentos del Análisis Económico I y II (Economía Cuantitativa), **Universidad Complutense de Madrid**, 1993, 2002; Dpto. de Economía, **Universidad de Valencia,** Valencia 1993; Dpto. de Estadística, **Universidad Complutense,** Madrid, 1995; Dpto. de Economía, **ESADE,** BARCELONA 1995: Dpto. de Economía, **Universidad de La Laguna,** La Laguna, 1996, 1998, 1999, 2001: Dpto. de Economía, **Universidad de Cantabria,** Santander, 1999; Dpto. de Economía Aplicada (Estadística y Econometría), **Universidad de Valladolid,** Valladolid, 1999, 2001; Dpto. de Fundamentos del Análisis Económico, **Universidad Autónoma de Madrid,** Madrid, 2001, 2006; **CEMFI**,Madrid, 2002; Dpto. de Economía, **Singapore Management University,** Singapur, 2002; Dpto. de Economía, **University of Canterbury,** Christchurch, 2002; Dpto. de Economía, **University of New South Wales,** Sidney, 2002; Dpto. de Estadística e Investigación Operativa, **Universidad Politécnica de Cataluña,**Barcelona, 2002; Dpto. de Economía, **Timbergen Institute,** Amsterdam, 2003; Dpto. de Estadística (Economía Aplicada), **Universidad de Alcalá,** Alcalá de Henares, 2004; Dpto. de Matemáticas, **Instituto Superior de Economía y Gestión,** Lisboa, 2004; Dpto. de Economía, **GREQAM**, Marsella, 2006; Dpto. de Economía, **Universitá Ca’ Foscari di Venecia**, *Outliers in GARCH models*, con A. Carnero y D. Peña, Venecia, 2007; Dpto. de Economía Aplicada, **Universidad de Oviedo,** *Outliers in GARCH models*, con A. Carnero y D. Peña, y *Fronteras del conocimiento en Econometría,* Oviedo, 2007; **Ente Einaudi for Monetary, Banking and Financial Studies,** *The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances*, Roma, Noviembre 2007; Dpto. de Economía de las Instituciones, Estadística Económica y Econometría, **Universidad de la Laguna,** *The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances*, La Laguna, Febrero 2008; **Tinbergen Institute**, *Bootstrap forecast in conditionally heteroscedastic unobserved component models,* con A. Rodríguez, Abril 2008; **Universidad Carlos III de Madrid**, Departamento de Ingeniería de Sistemas y Automática, Outliers in GARCH models, con M.A. Carnero y D. Peña, Octubre 2008; Dpto. de Economía Aplicada, **Universidad de Oviedo,** Conditionally heteroscedastic unobserved component models, con S. Pellegrini y A. Espasa, Noviembre 2008; Dpto. de Análisis Económico, **Universidad de Zaragoza**, Bootstrap prediction in unobserved component models, con A. Rodríguez, 13 de Marzo de 2009; Dpto. de Fundamentos del Análisis Económico, **Universidad Autónoma de Madrid,** Procedimientos bootstrap para la predicción en modelos con componentes inobservables, con A. Rodríguez, 12 de octubre de 2009; **ECARES (Bruselas),** Bootstrapping misspecified unobserved component models, Marzo 2011; **CREST (Paris),** Bootstrapping misspecified unobserved component models, Mayo 2011; **Banco de Chile (Santiago de Chile),** Afurther look at GARCH models with leverage effect, Julio 2011; Dpto. de Estadística, **Universidad de Concepción (Chile),** Afurther look at GARCH models with leverage effect, Julio 2011; Dpt. De Comercio, Finanzas y navegación, **Cyprus University of Technology,** More is not always better: back to the Kalman filter in Dynamic Factor Models, Noviembre 2012; Dpto. de Estadística, **University of British Columbia,** (seminario virtual), Bootstrap Forecasts, Mayo 2013; Dpto. de Estadística, **Universidad Nacional de Colombia**, Stochastic volatility with leverage effects, Enero 2014; CREATES, **Universidad de Aarhus**, Bootstrap bands for conditional correlations, febrero 2014; Center of Finance and Econometrics, Konstanz University, febrero 2015**;** Information Systems, Decision Sciences and Statistics (IDS) Dept., **ESSEC Business School,** **París,** April 2015;Nucleo de Investigacao em Politicas Económicas **(NIPE), Escola de Economia e Gestao, Universidade do Minho, Braga,** Asymmetric Stochastic volatility models: properties and estimation, octubre 2015; **Joint Research Center (European Commission),** Measuring the uncertainty of principal components in dynamic factor models,septiembre 2016; **Universidad de Liverpool, Management School,** marzo 2017; Joint statistics and econometrics workshops, **London School of Economics**, Measuring the uncertainty of principal components in dynamic factor models, marzo 2017; Seminario at Instituto de Econometría y estadística, **Universidad de Colonia**, enero 2018, Accurate confidence bounds for Principal Component Factors; Seminario at **CREST**, París, mayo 2018, Accurate confidence bounds for Principal Component Factors; Dpto. de Economía e Historia, **Universidad de Salamanca**, junio 2018, Growth at risk; Dpto. de Economía Aplicada, **Universitat de les Illes Baleares**, febrero 2020, Accurate prediction intervals for unobserved factors using subsampling; School of Management and Engineering, Capital University of Economics and Business, Beijing (China), marzo 2020 (Cancelado por COVID19).

11 BECAS, AYUDAS, RECONOCIMIENTOS Y PREMIOS RECIBIDOS

· BECA PARA AYUDA DE ESTUDIOS UNIVERSITARIOS, Ministerio de Educación y Ciencia, 1979-1984.

· BECA del ENTE VASCO DE ENERGÍA (EVE) para realización de la Tesina de Licenciatura, Bilbao, 1986.

· BECA PARA EXTENSIÓN DE ESTUDIOS EN EL EXTRANJERO, Consejería de Educación y Ciencia, Gobierno Vasco, 1987-1991.

· REVIEW OF ECONOMIC STUDIES TRAVEL FUND**,** Society for Economic Analysis, 1990, 200 £.

· AYUDA PARA LA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS Y REUNIONES DE CARÁCTER CIENTÍFICO-TECNOLÓGICO,Vicerrectorado de Investigación, Universidad Carlos III de Madrid, para la organización del First Internacional Institute of Forecasters Workshop: Nonlinearities, business cycles and forecasting (12-14/12/03), 2003, 2700 €.

· COMPLEMENTO RETRIBUTIVO LIGADO A MÉRITOS INDIVIDUALES DOCENTES, INVESTIGADORES Y DE GESTIÓN, Dpto. de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid, 2004.

· AYUDA PARA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS, Vicerrectorado de Investigación, Universidad Carlos III de Madrid,para la organización del 26th Internacional Symposium on Forecasting, 2006, 2000 €.

· Premio por docencia e investigación de la Universidad Carlos III de Madrid, diciembre 2007.

· COMPLEMENTO RETRIBUTIVO LIGADO A MÉRITOS INDIVIDUALES DOCENTES E INVESTIGADORES, Universidad Carlos III de Madrid, 2008, 2011, 2014.

· Premio de excelencia 2010 del Consejo Social de la Universidad Carlos III de Madrid para joven personal investigador.

· Mejor profesora y asignatura del Máster in Finance, Universidad Carlos III de Madrid, edición 2011-2012.

· AYUDA PARA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS, Vicerrectorado de Investigación, Universidad Carlos III de Madrid,para la organización del Workshop Honouring Antoni Espasa 2015, 1200 €.

· AYUDA PARA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS, Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid, para la organización del Workshop on Modeling Economic and Financial Time Series 2019, 900 €.

· AYUDA PARA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS, Vicerrectorado de Investigación, Universidad Carlos III de Madrid,para la organización del Workshop 2020, 1500 €.

· AYUDA PARA ORGANIZACIÓN DE CONGRESOS, Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas, Universidad Carlos III de Madrid, para la organización del Workshop 2020, 1500 €.

· International Institute of Forecasters FELLOW, since July 2020.

# 12 ACTIVIDAD EN EMPRESAS Y PROFESIÓN LIBRE

· Investigador colaborador en el proyecto “Modelos para el Análisis de la Coyuntura Española en su relación con las principales economías europeas”, patrocinado por ARGENTARIA y dirigido por A. Espasa, 1992-1993.

# · Proyecto Bankinter (Art. 83), Chequeo metodológico y de resultados de análisis sobre eficacia de fusiones bancarias para crear valor al accionista y sociedad 1987-2013, 3000 €, Julio 2015.

· Proyecto para Caja Laboral Popular S. Coop. De Crédito (Art. 83), Predicción del PIB y número de ocupados del País Vasco utilizando indicadores basados en extracción de señales mediante el filtro de Kalman, 6100 €, Octubre 2017.

· Proyecto para Caja Laboral Popular S. Coop. De Crédito (Art. 83), Predicción de variables macroeconómicas del País Vasco utilizando indicadores basados en extracción de señales mediante el filtro de Kalman: utilización de variables con distintas frecuencias, construcción de gráficos de abanico y predicción conjunta***,*** 6000 €, Noviembre 2018.

# 13 OTROS MÉRITOS DOCENTES O DE INVESTIGACIÓN

# Participación en Tribunales de Tesis Doctorales

DOCTORANDO: Regina Kaiser

ORGANISMO: Instituto Europeo Florencia

FECHA: Noviembre 1995

DOCTORANDO: Maria Victoria Esteban

ORGANISMO: Universidad del País Vasco

FECHA: Febrero 1996

DOCTORANDO: Eva Senra

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Junio 1998

DOCTORANDO: Manuel Jesús Vega Gordillo

ORGANISMO: Universidad de Navarra

FECHA: Noviembre 2000

DOCTORANDO: Michela Nardo

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Barcelona

FECHA: Diciembre 2000

DOCTORANDO: José Manuel Martínez

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Diciembre 2000

DOCTORANDO: Andrés Alonso

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Junio 2001

DOCTORANDO: Mª Dolores Márquez

ORGANISMO: Universidad Politécnica de Cataluña

FECHA: 2002

DOCTORANDO: Andrés Ubierna

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: 2003

DOCTORANDO: Maria Helena Veiga

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Barcelona

FECHA: 2004

DOCTORANDO: Ana García Sipols

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: 2004

DOCTORANDO: Trino Niguez

ORGANISMO: Universidad de Alicante

FECHA: 2004

DOCTORANDO: Rebeca Albacete

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: 2004

DOCTORANDO: Abdou Ka Diongue

ORGANISMO: Ecole Normale Superieure de Cachan (París)

FECHA: 2005

DOCTORANDO: Annastiina Silvennoinen

ORGANISMO: Stockholm School of Economics (Estocolmo)

FECHA: 2006

DOCTORANDO: Chritopher Strickland

ORGANISMO: Monash University (Australia)

FECHA: 2007

DOCTORANDO: Miguel Artiach

ORGANISMO: Universidad del País Vasco

FECHA: 2009

DOCTORANDO: Francisco Javier Eransus Armendáriz

ORGANISMO: Universidad Complutense de Madrid

FECHA: Febrero, 2010

DOCTORANDO: Miguel Angel Bermejo Mancera

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Octubre, 2011

DOCTORANDO: Rocío Alvarez Aranda

ORGANISMO: Universidad de Alicante

FECHA: Julio, 2012

DOCTORANDO: Hanwen Zhang

ORGANISMO: Universidad Nacional de Colombia

FECHA: Enero, 2014

DOCTORANDO: Marco Bazzi

ORGANISMO: PhD School of Statistics of the University of Padua

(External expert for Doctor Europeaus)

FECHA: Enero, 2015

DOCTORANDO: Guillermo Carlomagno

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Mayo, 2016

DOCTORANDO: Leopoldo Catania

ORGANISMO: University of Rome, “Tor Vergata”

FECHA: Septiembre, 2017

DOCTORANDO: Johan Stax Jalobsen

ORGANISMO: University of Aarhus

FECHA: 2018

DOCTORANDO: Philipp Christian Kless

ORGANISMO: University of Copenhagen

FECHA: Mayo, 2019

DOCTORANDO: Juan Vicente Bógalo Román

ORGANISMO: Universidad Alcalá de Henares

FECHA: Octubre, 2019

DOCTORANDO: Angela Caro

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: Diciembre, 2020

DOCTORANDO: Gianluca Giudice

ORGANISMO: London School of Economics

FECHA: Octubre, 2022

DOCTORANDO: Lars E. Spreng

ORGANISMO: City University (Londres)

FECHA: Julio, 2023

DOCTORANDO: Ignacio Garrón Vedia

ORGANISMO: Universitat de Barcelona

FECHA: Julio, 2023

# Miembro de Tribunales de Titularidades y Cátedras

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: CUC8/1-D00044-6

FECHA BOE: 09/04/2009

ÁREA DE CONOCIMIENTO: Fundamentos del Análisis Económico

ORGANISMO: Universidad del País Vasco, Dpto. Fundamentos del Análisis Económico II

FECHA: 9 Junio, 2009

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000444

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. Estadística

FECHA: 19 Noviembre, 2009

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF02623

ORGANISMO: Universidad de Alicante, Dpto. Fundamentos del Análisis Económico

FECHA: Enero, 2010

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000353

FECHA BOE: 27 de mayo de 2010

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. Estadística

FECHA: Junio, 2010

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: G053/D05305

FECHA BOE: 27 de mayo de 2010

ORGANISMO: Universidad de Salamanca, Dpto. Fundamentos del Análisis Económico

FECHA: Septiembre, 2010

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: UAM-A243TU

FECHA BOE: 25 de julio de 2011

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Madrid, Dpto. de Análisis Económico: Métodos cuantitativos

FECHA: Octubre, 2011

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000592

FECHA BOE: 24 de abril de 2012

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. de Estadística

FECHA: Julio, 2012

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000619

FECHA BOE: 17 de abril de 2012

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. de Estadística

FECHA: Septiembre, 2012

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: UAM-A319TU

FECHA BOE: 20 de junio de 2014

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Madrid, Dpto. de Fundamentos de Análisis Económico (Estadística y Econometría)

FECHA: 22 Mayo, 2014

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA:

FECHA BOE: 2015

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. de Estadística

FECHA: 21 Septiembre, 2015

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: G053/d05307

FECHA BOE: 9 enero 2018

ORGANISMO: Universidad de Salamanca

FECHA: 20 Marzo 2018

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: CUCB/1-D00038-10

FECHA BOE: 9 marzo 2018

ORGANISMO: Universidad del País Vasco

FECHA: 10 julio 2018

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000761/62

FECHA BOE: 30 octubre 2018

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid

FECHA: 14 de enero 2019

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: DF000796

FECHA BOE: 30 octubre 2018

ORGANISMO: Universidad Carlos III de Madrid, Dpto. de Ciencias Sociales

FECHA: 30 enero 2019

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: UAM-P412CU

FECHA BOE: 29 marzo 2019

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Madrid

FECHA: 9 junio 2019

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: G053/D05308

FECHA BOE: 20 de mayo de 2019

ORGANISMO: Universidad de Salamanca

FECHA: 10 julio 2019

POSICIÓN: Lecturer

CODIGO DE LA PLAZA: UAB-LE-9076

FECHA BOE:

ORGANISMO: Universidad Autónoma de Barcelona (programa Serra Húnter Programme)

FECHA: 2021

POSICIÓN: Profesor titular de universidad

CODIGO DE LA PLAZA: 155/2021

FECHA BOE: 21 de junio de 2021

ORGANISMO: Universidad de Valencia

FECHA: 2021

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: 2021-55

FECHA BOE:

ORGANISMO: Universidad de Zaragoza

FECHA: febrero 2022

POSICIÓN: Catedrático de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA: Christina Christou

ORGANISMO: Open University of Cyprus

FECHA: 2022

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA:602321

FECHA BOE:

ORGANISMO: Universitat de Illes Balears

FECHA: mayo 2022

POSICIÓN: Titular de Universidad

CODIGO DE LA PLAZA:602322

FECHA BOE:

ORGANISMO: Universitat de Illes Balears

FECHA: mayo 2022

# Evaluación de revistas científicas y documentos de trabajo

**a) Nacionales:** *Fundación BBVA*; *Investigaciones Económicas*; *IVIE*; *Moneda y Crédito*; *Revista Asturiana de Economía*; *Revista de Economía Aplicada*; *Revista de Economía Financiera*; *Revista Española de Economía (SER)*; *Revista Estadística Española*; *TEST*

**b) Internacionales:** *Biometrika*; *Brazilian Journal of Probability and Statistics*; *Cambridge University Press;**Computational Statistics & Data Analysis; Communications in Statistics: Theory and Methods*; *Economía Mexicana. Nueva Epoca*; *Economic Bulletin*; *Economic Modelling*; *Economics Letters*; *Econometric Reviews*; *International Journal of Forecasting*; *Journal of Applied Econometrics*; *Journal of Applied Probability and Statistics*; *Journal of Business & Economic Statistics*; *Journal of Econometrics*; *Journal of Economic Surveys*; *Journal of Empirical Finance*; *Journal of Financial Econometrics*; *Journal of International Money and Finance; Journal of Statistical Planning and Inference*; *Journal of the American Statistical Association*; *Journal of the Royal Statistical Society (A)*; *Journal of Time Series Analysis*; *Quantitative Finance*; *Review of Economics and Statistics*; *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*; *The Econometrics Journal*; *The Economic Journal*; *The European Journal of Finance.*

* 1. **Miembro de comités editoriales de revistas científicas**

· Editora jefa de *International Journal of Forecasting*. Enero 2019-Septiembre 2019.

· Editora Asociada de *Computational Statistics & Data Analysis*. Septiembre 2007-Diciembre 2010

· Co-Editora de *International Journal of Forecasting,* Enero 2009-Diciembre 2018 y Octubre 2019-actualidad.

**·** Editora Asociada Invitada de Annals of Computational Econometrics (CSDA), Diciembre 2010-Diciembre 2013.

· Miembro del Comité Asesor de la Colección de Publicaciones de la UPV/EHY en Economía y Empresa, Mayo 2016-actualidad.

· Editora Asociada de *Latin American Economic Review* (LAER), Enero 2018-actualidad.

# Edición de Números Especiales de revistas y libros

· Co-editora, junto con A. García-Ferrer, J. De Gooijer y P. Poncela, del número especial titulado “Nonlinearities, Business Cycles and Forecasting”, **Internacional Journal of Forecasting**, 2005, vol. 21, 4, 623-808.

· Co-editora, junto con Nuno Crato, del número especial titulado “Forecasting Financial Markets”, **Internacional Journal of Forecasting,** 2012, vol. 28, 1-2.

· Co-editora, junto con S.G. Pollock, T. Proietti y H. Weinert del 3er número especial titulado “Statistical Signal Extraction and Filtering”, **Computacional Statistics & Data Analysis,** 2013, vol. 58.

· Co-editora, junto con Miriam Scaglione y Dean Croushore, del número especial titulado “Flash Indicators”, **International Journal of Forecasting,** 2013, vol. 29.

· Co-editora, junto con Daniel Peña y Alvaro Escribano, del número especial titulado “30 Years of Cointegration and Dynamic Factor Models Forecasting and its Future with Big Data: Editorial”, **International Journal of Forecasting**, 2021, vol. 37

· Co-editora, junto con Daniel Peña y Pilar Poncela de los volúmenes titulados “Predicción con Datos masivos” y “Economía con datos masivos” para FUNCAS

# Miembro de Asociaciones Científicas

· Econometric Society durante diversos periodos.

· Asociación Española de Economía. Durante diversos periodos.

· International Institute of Forecasters (IIF). Desde 2001 hasta la actualidad. Miembro del Board of Directors desde abril 2009 hasta mayo de 2017 y desde enero a septiembre de 2019.

* 1. **Organización de congresos**

**a) Comité organizador**

· European Course in Advanced Statistics on Time Series Analysis, Septiembre, 1997, San Lorenzo del Escorial.

· First International Institute of Forecaster`s Workshop, “Nonlinearities, Business Cycles and Forecasting”, Diciembre 2003, Madrid.

· 26th International Symposium on Forecasting, Junio 2006, Santander.

· Fith International Institute of Forecaster`s Workshop, “Forecasting in Financial Markets”, Enero 2009, Lisboa.

· Fourth International Conference on Computational and Financial Econometrics, Londres, Diciembre 2010.

· 7th International Institute of Forecaster`s Workshop, “Flash indicators”, Enero 2011, Verbier (Suiza).

· **Chair**, First Meeting on Time Series Modelling and Computation, Julio 2013, Universidad Carlos III de Madrid.

· Workshop Honouring Antoni Espasa, Junio 2015, Universidad Carlos III de Madrid.

· Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance (MAF, 2018), Universidad Carlos III de Madrid, April 4-6, 2018.

· Workshop on Modelling Economic and Financial Time Series, 7 Junio 2019, Universidad Carlos III de Madrid.

· Organización de las jornadas de Predicción y Economía con datos masivos, 8 de octubre y 18 de noviembre de 2020 (Online por COVID19), Fundación Funcas, Madrid

**b) Comité científico**

· 15th International Workshop on Statistical Modelling, Bilbao, 2000

· XXIX Simposio de Análisis Económico, Universidad de Navarra, Diciembre 2004.

· XIII Foro de Finanzas, Madrid, 2005.

· XXXII Simposio de Análisis Económico, Granada, 2007.

· 2nd International Workshop on Computational and Financial Econometrics, Neuchâtel (Suiza), Junio 2008.

· COMPSTAT, Oporto, 2008.

· XXIII Simposio de Análisis Económico, Universidad de Zaragoza, Diciembre 2008.

· 3er Internacional Conference on Computacional and Financial Econometrics (CFE’09), Octubre 2009, Limassol, Chipre.

· XXIV Simposio de Análisis Económico, Universidad de Valencia, Diciembre 2009.

· III Jornadas de Docencia en Econometría y Estadística, Murcia, Junio 2011.

· **Chair Program Committee** International Symposium Forecasting, Junio 2015, Riverside (California, EEUU).

· International Symposium Forecasting, Junio 2016, Santander.

· 9th Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics (ICEEE), Enero 2021, Universidad de Cagliari, Italia.

· Italian Workshop of Econometrics and Empirical Economics (IWEEE), Enero 2022, University of Bologna, Rimini.

· Workshop on Time Series Econometrics, March 2022, March 2023, Zaragoza

· Time Series Statistics and Econometrics Meeting, Florianoloplis (Brasil), Julio-Agosto 2023.

# Miembro de Comités Evaluadores

**· EVALUADORA** de Proyectos de Investigación de la **AGENCIA NACIONAL DE EVALUACIÓN Y PROSPECTIVA (ANEP)**, Ministerio de Ciencia y Tecnología; Secretaría de Estado de Política Científica y Tecnología, varias convocatorias.

· Evaluadora de proyectos de Investigación para el National Science Center (Poland), Abril 2022.

**· Miembro** del comité de selección de posiciones post-doc en el Center for Applied Mathematics and Economics (CEMAPRE) de la Universidad Politécnica de Lisboa, diciembre 2007, octubre 2008.

· Miembro del comité de selección de investigadores del IKERBASQUE, Octubre 2008.

· Colaborador de Economía de la Comisión de expertos Evaluadora de proyectos de I+D del Ministerio de Educación para la convocatoria de 2008.

· Miembro de la Comisión de Valoración del programa de Cátedras de Excelencia de la UC3M-Banco de Santander, Diciembre 2010.

· Miembro de la Comisión de profesorado de Fundamentos del Análisis Económico, Universidad Autónoma de Madrid, Septiembre 2010-actualidad.

· Miembro del panel de expertos del programa ACADEMIA de ANECA, Noviembre 2011-Junio 2012.

· Miembro del comité de expertos para la promoción a profesor Titular de Christos Savva en el departamento de Comercio, Finanzas y Navegación de la Cyprus University of Technology, Noviembre 2012.

· Vocal especializado del Tribunal en el proceso para proveer plazas en el nivel 14 del grupo directivo para desempeñar cometidos de Técnico de Banco de España, Mayo 2014, Mayo 2015, Mayo 2016, Mayo 2018.

· Vocal especializado en las oposiciones de plazas en el nivel 9 del grupo directivo de Inspectores de entidades de crédito del Banco de España. Noviembre 2018.

· Panel member (Computer and Information Sciences and Mathematics), Stimulus of Scientific Employment, Call, Fundacao para a Ciencia e a Tecnologia (Portugal). Individual Support-2017. Individual Support-2018.

· Miembro del comité seleccionador de Profesores Lectores del Programa Serra Hunter, UAB-LE-7064, Universidad Autónoma de Barcelona, septiembre 2019.

· Evaluadora, Dirección de Evaluación y Acreditación, Agencia Andaluza del Conocimiento, desde febrero 2021.

· Vocal titular de la Comisión de Acreditación D15-Ciencias Económicas, ANECA, desde abril 2021.

· Evaluadora de proyectos para el Independent Research Fund|Social Sciences, Danish Agency of Higher education and Science, case number 2065-00046A, Julio 2022.

· Miembro del Comité para la selección de candidatos para plazas de profesor titular en Econometría, ISEG (Lisboa), ref. 1361/2021.

# 14. OTROS MÉRITOS

· Miembro de la Junta de Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad del País Vasco, 1986-1987.

· Subdirectora del departamento de Estadística y Econometría de la Universidad Carlos III de Madrid, 1996-2000.

· Subdirectora del máster y doctorado en Administración de Empresas y Métodos Cuantitativos del departamento de Estadística de la universidad Carlos III de Madrid, septiembre 2006-Febrero 2009.

· MIEMBRO DEL CLAUSTROde la Universidad Carlos III de Madrid, 1992-actualidad.

· MIEMBRO DE LA JUNTA DE FACULTAD DE CIENCIAS SOCIALES Y JURÍDICAS de la Universidad Carlos III de Madrid, 2000-2015.

· Miembro de la comisión de economía para la elaboración del Plan de Estudios de Grado en Economía de la Universidad Carlos III de Madrid, 2007-2008.

· Subdirectora del Instituto Flores de Lemus, Universidad Carlos III de Madrid, octubre 2008-2015.

· Miembro del Comité de Igualdad del Vicerrectorado de Igualdad de la Universidad Carlos III de Madrid, Febrero 2009-Julio 2019.

· Vocal de la Comisión Básica de la rama de Ciencias Sociales para la selección de profesores titulares de universidad interinos, Universidad Carlos III de Madrid, Febrero 2009-actualidad.

· Directora del departamento de Estadística, Universidad Carlos III de Madrid, Septiembre 2011-May 2015.

· Miembro del comité de selección de profesorado de la Ftad. de Ciencias Económicas de la Universidad Autónoma de Madrid, 2011-2017.

· Miembro del Consejo de Gobierno de la Universidad Carlos III de Madrid, diciembre 2011-Mayo 2016, septiembre 2018-actualidad

· Lección inaugural del curso 2012-2013 de la universidad Carlos III de Madrid: Técnicas de predicción: del oráculo de Delfos a los modelos estadísticos. 18 de septiembre de 2012.

· Miembro de la Comisión Académica del Master en Ingeniería Matemática, 2011-2012.

· Miembro de la Comisión Académica del Master en Economía de la Empresa y Métodos Cuantitativos, 2011-2012.

· Miembro del comité seleccionador de Proyectos para la organización de congresos y reuniones científicas (2019) cuyo eje central de análisis sean los estudios de género y la igualdad entre hombres y mujeres (BOEL 23 de enero de 2019).