

DEPARTAMENTO DE  
ESTADISTICA

## DEPARTAMENTO DE ESTADISTICA

### Áreas de conocimiento:

- ESTADISTICA E INVESTIGACION OPERATIVA
- FUNDAMENTOS DEL ANALISIS ECONOMICO

## ÁREA DE CONOCIMIENTO: ESTADISTICA E INVESTIGACION OPERATIVA

### Actividades de investigación

#### Tesis Doctorales

- Métodos de clustering en datos de expresión génica  
*Autores:* TORRENTE, E. A.  
*Director:* ROMO, J.  
*Centro donde se presentó:* Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas  
*Año:* 2007

### Publicaciones y actividades de difusión de resultados

#### Artículos en revistas nacionales

- NIÑO, J.  
Dynamic priority allocation via restless bandit marginal productivity indices, *TOP*, Núm. 2, 2007, pp. 161-198, ESPAÑA.
- NIÑO, J.  
Rejoinder on: dynamic priority allocation via restless bandit marginal productivity indices, *TOP*, 2007, ESPAÑA.
- PEÑA, D. ; SANCHEZ, I.  
El análisis de series temporales: situación y perspectivas, *Boletín de la Sociedad Española de Estadística e Investigación Operativa*, Núm. 4, 2007, pp. 4-8, ESPAÑA.

#### Artículos en revistas extranjeras

- ALIBES, A.; MORRISSEY, E.R.; CAÑADA, A.; RUEDA, O.; CASADO, D.; YANKILEVICH, P.; WECK, A.; DIAZ-URIARTE, R.  
Asterias: a parallelized web-based suite for the analysis of expression and aCGH data, *Cancer Informatics*, 2007, pp. 1-9, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- AVELLA, P.; D'AURIA, B.; SALERNO, S.; VASILEV, I.  
A computational study of local search algorithms for Italian high-school timetabling, *Journal of Heuristics*, Vol. 13, 2007, pp. 543-556, HOLANDA.
- BARRIOS, M.P.; VELILLA, S.  
A bootstrap method for assessing the dimension of a general regression problem , *Statistics & probability letters*, 2007, pp. 247-255, HOLANDA.

- Boj del Val, E.; GRANE, A.; Claramunt Bielsa, M.M.; Fortiana Gregori, J.  
Implementing PLS for distance-based regression: computational issues , *Computational statistics*, Núm. 22, 2007, pp. 237-248, ALEMANIA.
- CANOVAS, L.; GARCIA, S.; LABBE, M.; MARIN, A.  
A strengthened formulation for the simple plant location problem with order , *Operations Research Letters*, Núm. 2, 2007, pp. 141-150, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- CANOVAS, L.; GARCIA, S.; MARÍN, A.  
Solving the uncapacitated multiple allocation hub location problem by means of a dual-ascent technique, *European Journal of Operational Research*, Núm. 3, 2007, pp. 990-1007, HOLANDA.
- CARRIZOSA, E.; MARTIN, B.; PLASTRIA, F.; ROMERO, D.  
On the selection of the globally optimal prototype// subset for NN classification, *INFORMS Journal on Computing*, 2007, pp. 1091-9856.
- CASCOS, I.  
The expected convex hull trimmed regions of a sample , *Computational statistics*, 2007, pp. 557-569, ALEMANIA.
- CASCOS, I.; MOLCHANOV, I.  
Multivariate risks and depth-trimmed regions, *Finance and Stochastics*, Vol. 11, Núm. 3, 2007, pp. 373-397.
- D'AURIA, B.  
Stochastic decomposition of the M/G, *Operations Research Letters*, Vol. 35, Núm. 6, 2007, pp. 805-812, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- D'AURIA, B.  
M/M/- Queues in Semi-Markovian Random Environment, *EURANDOM*, 2007, pp. 1-15.
- FLORES, R.J.; NUCINKIS, B.  
On Bredon dimensions of elementary amenable groups , *Proceedings of the american mathematical society*, 2007, pp. 5-11, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- GALEANO, P.; PEÑA, D.  
On the connection between model selection criteria and quadratic discrimination in ARIMA time series models , *Statistics & probability letters*, 2007, pp. 896-900, HOLANDA.
- GALEANO, P.; PEÑA, D.  
Improved model selection criteria for SETAR time series models , *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2007, pp. 2802-2814, HOLANDA.
- GALEANO, P.; PEÑA, D.  
Covariance Changes Detection in Multivariate Time Series, *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2007, pp. 194-2117, HOLANDA.
- GARCIA, A.; JEREZ, M.; CASALS, J.  
Detección de Raíces Unitarias y Cointegración mediante Métodos de Subespacios, *Revista Colombiana de Estadística*, Núm. 1, 2007, pp. 77-96, COLOMBIA.
- HEINEN, A.J.; RENGIFO, E.  
Multivariate modelling of time series count data: an autoregressive conditional poisson model , *Journal of Empirical Finance*, Núm. 4, 2007, pp. 564-583, HOLANDA.

- JACKO, P.; NIÑO, J.  
Time-constrained restless bandits and the knapsack problem for perishable items, *Electronic Notes in Discrete Mathematics*, 2007, pp. 145-152.
- JIMENEZ, R.J.; SHAO, Y.  
Asymptotic distribution for symmetric spacing statistics , *Communications in statistics: Theory and Methods*, 2007, pp. 37-46, CANADÁ.
- LETON, E.; ZULUAGA, P.  
A note on the variances of the tests of kendall, jonckheere, and terpstra , *Communications in statistics: Theory and Methods*, 2007, CANADÁ.
- LETON, E.; ZULUAGA, P.  
Relationships among tests for censored data , *Biometrical Journal* , Vol. 47-3, 2007, pp. 377-387.
- LOPES MOREIRA, M.H.  
Are feedback factors important in modelling financial data? , *International Review of Finance-the official journal of the Asia Pacific Finance Association and the Nippon Finance Association*, Núm. 3-4, 2007, pp. 105-118, REINO UNIDO.
- LOPEZ, S.; ROMO, J.  
A depth-based inference for functional data, *COMPUTACIONAL STATISTICS AND DATA ANALYSIS*, Núm. 10, 2007, pp. 4957-4968.
- MAHARAJ, E.A.; ALONSO, A.M.  
Discrimination of locally stationary time series using wavelets, *Computational Statistics and Data Analysis*, 2007, pp. 879-895, HOLANDA.
- MARTINEZ, M. A. ; PANTOJA, M.; ABENOJAR, J. ; VELASCO, F. ; DURBAN, M. L.  
Analysis of shear strength of cylindrical assemblies with anaerobic adhesives using Weibull statistics, *Journal of Adhesion Science and Technology*, Vol. 21, Núm. 16, 2007, pp. 1659-1669.
- MOGUERZA, J.M.; OLIVARES, A.; PRIETO, F. J.  
A note on the use of vector barrier parameters for interior-point methods, *European Journal of Operational Research*, 2007, pp. 571-585, HOLANDA.
- MOLINA, I. ; MORALES, D.  
Rényi Statistics for Testing Hypotheses in mixed linear regression models , *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2007, pp. 87-102, HOLANDA.
- MOLINA, I. ; MORALES, D.; SANTAMARIA, L. ; GONZALEZ-MANTEIGA, W.; LOMBARDIA, M.  
Estimation of the mean squared error of predictors of small area linear parameters under a logistic mixed model , *Computational Statistics & Data Analysis*, 2007, pp. 2720-2733, HOLANDA.
- MOLINA, I. ; SAEI, A.; LOMBARDIA, M.  
Small area estimates of labour force participation under a multinomial logit mixed model, *Journal of the Royal Statistical Society*, 2007, REINO UNIDO.
- MOLINA, I. ; SAEI, A.; LOMBARDIA, M.J.  
Estimation of unemployment rates in small areas by a multinomial logit mixed model , *Journal of the Royal Statistical Society*, 2007, pp. 975-1000, REINO UNIDO.
- NIÑO, J.  
A fast-pivoting algorithm for the Gittins index and optimal stopping of a Markov chain, *INFORMS Journal on Computing*, Núm. 4, 2007, pp. 596-606.

- PANTOJA, M.; ABENOJAR, J. ; VELASCO, F. ; MARTINEZ, M. A. ; DURBAN, M. L.  
Analysis of substrate preparation and curing position on mechanical properties of adhesive joints using statistical metho, *Journal of Adhesion Science and Technology*, Vol. 21, Núm. 11, 2007, pp. 1045-1058.
- PEÑA, D.  
Comments on the Survey of Robust Methods by S. Morgenthaler , *Statistical Methods and Applications*, 2007, pp. 288-290, AUSTRIA.
- PEÑA, D. ; BENITO, M.  
Detecting defects with image data, *Computational Statistics and Data Analysis*, 2007, pp. 6395-6403, HOLANDA.
- PEÑA, D. ; PRIETO, F. J.  
Combining random and specific directions for outlier detection and robust estimation of high-dimensional multivariate data, *Journal of Computational & Graphical Statistics*, Núm. 16, 2007, pp. 228-254, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- PEÑA, D. ; SANCHEZ, I.  
Measuring the advantage of multivariate versus univariate forecasts, *Journal of time series analysis*, 2007, pp. 886-909, REINO UNIDO.
- PEÑA, D. ; VAN DER LINDE, A.  
General measures of variability and dependence for multivariate continuous distributions , *Communications in statistics: Theory and Methods*, 2007, pp. 1845-1854, CANADÁ.
- UBIERNA, A.; VELILLA, S.  
A goodness-of-fit process for ARMA(p,q) models based on a modified residual autocorrelation sequence, *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2007, pp. 2903-2919, HOLANDA.

## Libros

- ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J. ; GIULIODORI, R.F.; KARL, A.; ANDONIAN, O.; GIULIODORI, M.A.  
La atención de las personas dependientes en Argentina, *Asoc Cooperadora FCE-UNC, Universidad Nacional de Córdoba*, 2007.
- ALONSO, P. J. ; ALBARRAN, I.  
Análisis del riesgo en seguros en el marco de Solvencia II: técnicas estadísticas avanzadas. Monte Carlos y Bootstrapping, *Fundación MAPFRE*, ESPAÑA, 2007.
- GRANE, A.; Baíllo Moreno, A.  
100 Problemas resueltos de Estadística Multivariante (implementados en Matlab), ESPAÑA, 2007.

## Monografías Científicas

- DURBAN, M. L.  
Splines con Penalizaciones: Teoría y Aplicaciones , *Universidad Pública de Navarra*, ESPAÑA, 2007.

## Colaboraciones en obras colectivas

- FLORES, R.J.  
*Classifying spaces of wallpaper groups* , en: Geometrics Group Theory. Trends in Mathematics, Birkhauser, pp. 51-64, 2007.
- LOPES MOREIRA, M.H.  
*Volatility modelling and accurate minimum capital risk requirements: A comparison among several approaches* , en: Proceedings of XXII International Workshop on Statistical Modelling , pp. 291-294, 2007.
- MUÑOZ, A. ; GONZALEZ, J.  
*Joint diagonalization of kernels for information fusion*, en: LNCS, ESPAÑA, pp. 556-563, 2007.
- MUÑOZ, A. ; GONZALEZ, J.  
*Spectral measures for kernel matrices comparison* , en: LNCS, ESPAÑA, pp. 727-736, 2007.
- MUÑOZ, A. ; MOGUERZA, J.; PSARAKIS, S.  
*Monitoring nonlinear profiles using support vector machines* , en: LNCS, ESPAÑA, pp. 574-583, 2007.
- WIPER, M. P.  
*Markov chain Monte Carlo, Introduction* , en: Encyclopedia of Statistics in Quality and Reliability, WILEY, pp. 1014-1020, 2007.
- WIPER, M. P.  
*Software Reliability: Bayesian Analysis* , en: Encyclopedia of Statistics in Quality and Reliability , WILEY, pp. 1859-1963, 2007.

## Documentos de trabajo

- BAILLO, A.; GRANE, A.  
Local linear regression for functional predictor and scalar response , *WP 07-63 Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.
- CASCOS, I.  
Depth functions based on a number of observations of a random vector , *WP 07-29. Statistics and Econometrics Series. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.
- GARCIA, A.; JEREZ, M.; CASALS, J.  
Unit Roots and Cointegration Matrix Estimation with Subspace Methods. WP0611 , *ICAE*, 2007.
- GRANE, A.; FORTIANA, J.  
A scale-free adaptive statistic for testing exponentiality against Weibull and Generalized Pareto distributions, *WP 07-56. Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.
- GRANE, A.; LOPES MOREIRA, M.H.  
The effect of realised volatility on stock returns risk estimates , *WP 07-63 Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.
- GRANE, A.; LOPES MOREIRA, M.H.  
Volatility modelling and accurate minimum capital risk requirements: a comparison among several approaches , *WP 07-47 (13) Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.

- LOPES MOREIRA, M.H.  
The sign of asymmetry and the Taylor effect in stochastic volatility models , *WP 07-07 (02) Serie de Estadística y Econometría*, 2007.
- MOLINA, I.  
Bootstrap for estimating the mean squared error of the spatial EBLUP , *WP 07-34 (08) Statistics and Econometrics Series*, 2007.
- PELLEGRINI S. ; RUIZ, E. ; ESPASA, A.  
The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances , *Statistics and Econometrics Series WP 07-27*, 2007.
- TENA. J.; SALAZAR, C.  
Explaining inflation and output volatility in Chile: an empirical analysis of forty years , *WP 07-15 Serie de Estadística y Econometría*, 2007.

## Ponencias y Comunicaciones a congresos

- Albareda-Sambola, M. ; ALONSO-AYUSO, A.; MOLINA, E. ; SIMON, C.  
*A heuristic algorithm for order batching in a warehouse* , EURO XXII, PRAGA, 2007.
- ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J.  
*Incidencia de variables socio-sanitarias en los distintos perfiles de la población dependiente española* , 2nd Workshop on Risk Management and Insurance Research, CASTRO URDIALES, ESPAÑA, 2007.
- ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J. ; FAJARDO, M.A.  
*Discapacidad, dependencia y empleo* , I Seminario Internacional ASEPELT sobre Economía, Discapacidad y Empleo, MADRID, ESPAÑA, 2007.
- ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J. ; FAJARDO, M.A.  
*Análisis y clasificación de la población dependiente española* , XI Conferencia Española de Biometría y I Encuentro Iberoamericano de Biometría, SALAMANCA, ESPAÑA, 2007.
- ALONSO, A.M.; CASADO, D.; LOPEZ, S.; ROMO, J.  
*Classification for time series based on functional depth* , The 27th Annual International Symposium on Forecasting, New York, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA, 2007.
- ALONSO, A.M.; MAHARAJ, E.A.  
*Discrimination of locally stationary time series* , XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, VALLADOLID, ESPAÑA, 2007.
- ALONSO, P. J. ; ALBARRAN, I.  
*Elección entre modelo general y modelo interno a partir de la evidencia de las empresas aseguradoras españolas*, 2nd Workshop on Risk Management and insurance research, CASTRO URDIALES, ESPAÑA, 2007.
- ALONSO, P. J. ; ALBARRAN, I.; FAJARDO, M.A.  
*Medición del efecto de la edad sobre la dependencia mediante regresión localmente ponderada* , XXI Reunión anual ASEPELT, VALLADOLID, ESPAÑA, 2007.
- ARTEAGA, B. ; GARCIA, M.  
*Estrategias de educación adaptativa y mejora del rendimiento en matemáticas de los alumnos de 4º de ESO* , XII Congreso Nacional de Modelos de Investigación Educativa: Convivencia, Equidad, Calidad. San Sebastián., ESPAÑA, 2007.



- CARNERO, M. A. ; PEÑA, D. ; RUIZ, E.  
*Outliers in GARCH models*, International Symposium on Business and Industrial Statistics, *ISLAS AZORES*, 2007.
- CASCOS, I.  
*The financial risk of a set portfolio* , 15th European Young Statisticians Meetings (EYSM 2007), *CASTRO URDIALES*, ESPAÑA, 2007.
- DEMIGUEL, A.V.; NOGALES, F. J.  
*Portfolio Selection with Robust Estimation* , INFORMS Annual Meeting, *Seattle*, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA, 2007.
- DEMIGUEL, A.V.; NOGALES, F. J.  
*Portfolio Selection with Robust Estimation* , EURO XXI, REPUBLICA CHECA, 2007.
- FAJARDO, M.A.; ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J.  
*Caracterización de distribuciones a partir de sus condicionadas. Aplicaciones.* , VII Seminario ASEPELT sobre Modelos de Generación de funciones: propiedades y aplicaciones, *JARANDILLA DE LA VERA*, ESPAÑA, 2007.
- FLORES, R.J.  
*Strongly closed subgroups and cellularization*, Primer Congreso Hispano-Francés de Matemáticas, *ZARAGOZA*, ESPAÑA, 2007.
- FRANCO, A. M. ; LILLO, R. E. ; ROMO, J.  
*Ordenaciones estocásticas basadas en la función cuantílica residual* , XIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- GARCIA, A.; LLOPIS, E.; GARCIA MONTERO, H.; GONZALEZ MARISCAL, M.; HERNANDEZ, R.  
*Índices de precios de tres ciudades españolas, 1680-1800: Madrid-Palencia y Sevilla* , 1st Latin-American Economic History Congress, *MONTEVIDEO*, 2007.
- GARCIA, D.; ALONSO, A.M.; JUSTEL, A.; BENAYAS, J.  
*La importancia de las series temporales en la evaluación de la sostenibilidad* , I Congreso Nacional sobre Cambio Global, *GETAFE*, ESPAÑA, 2007.
- GARCIA FERRER, A.; GONZALEZ, E.; PEÑA, D.  
*Independent component analysis for economic time series forecasting*, The 27th annual international symposium on forecasting: financial forecasting in a global economy, *Nueva York*, 2007.
- GARCIA, S.  
*The Simple Plant Location Problem with Order: locating with preferences* , Operations Research, *Saarbrücken*, ALEMANIA, 2007.
- GARCIA, S.  
*Chvatal T-inequalities for the p-median simple plant location problem with order* , EURO Winter Institute on Location and Logistics, *Estoril*, 2007.
- GARCIA, S.  
*Chvatal T-inequalities for the p-median simple plant location problem with order* , Reunión de la Red Temática de Localización (Location Network Meeting), *BAEZA*, ESPAÑA, 2007.
- GARCIA, S.; CÁNOVAS, A.; MARIN, A.  
*The Simple Plant Location Problem with simple plant location problem with order*, INOC, *BÉLGICA*, 2007.

- GARCIA, S.; CANOVAS, L.; MARIN, A.  
*New inequalities for the p-median simple plant location problem with order* , INOC 2007, BÉLGICA, 2007.
- GONZALEZ, I.; SANCHEZ, I.  
*Capability Indices and Nonconforming Proportion in Univariate and Multivariate Processes* , XXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, VALLADOLID, ESPAÑA, 2007.
- GONZALEZ, J.; MUÑOZ, A.  
*Joint diagonalization of kernels for information fusion* , CIARP 2007, Valparaiso, 2007.
- GRANE, A.  
*A functional PLS algorithm, with application to goodness-of-fit tests*, en: 5th International symposium. Causalities explored by indirect observation, 2007.
- HEINEN, A.J.; CHOLLETE, L.  
*An frequent turbulence? A dynamic copula approach*, Multivariate Volatility Models, FARO, 2007.
- HEINEN, A.J.; RENGIFO, E.  
*Multivariate reduced rank regression in non-Gaussian contexts, using copulas* , Econometric Society European Meeting, BUDAPEST, 2007.
- JACH, A.E.; KOKOSZKA, P.  
*Robust wavelet-domain estimation of the fractional difference parameter in heavy-tailed time series*, Lévy Processes: Theory and applications, COPENHAGEN, DINAMARCA, 2007.
- JACKO, P.; SANZO, B.  
*Congestion avoidance with future-path information* ; en: Proceedings of EuroFGI Workshop on IP QoS and traffic control, 2007.
- LEE, D.-J.  
*Spatial and spatio-temporal smoothing mixed models* , Smoothing-based and gaussian-process based methods for non-parametric regression in environmental problems, 2007.
- LEE, D.-J.; DURBAN, M. L.  
*Smoothing mixed models for overdispersed spatial count data* , 22 International Workshop on Statistical Modelling, BARCELONA, ESPAÑA, 2007.
- LOPES MOREIRA, M.H.  
*Volatility modelling and accurate minimum capital risk requirements: A comparison among several approaches* ; en: Proceedings of XXII International Workshop on Statistical Modelling, 2007.
- LOPEZ, A. ; ROMO, J.  
*Funciones de similaridad basadas en la idea de profundidad* , XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, VALLADOLID, ESPAÑA, 2007.
- MOLINA, E. ; TEJADA, J.  
*Centrality in a quick information diffusion process*, EURO XXII, PRAGA, 2007.
- MOLINA, I.  
*Uncertainty under a multivariate nested-error regression model with logarithmic transformation* , ISI 2007, PISA, 2007.
- MOLINA, I.  
*Error de predicción bajo un modelo multivariante de errores anidados con transformación logarítmica*, XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, VALLADOLID, ESPAÑA, 2007.

- MOLINA, I. ; SALVATI, N.; PRATESI, M.  
*Bootstrap for estimating the mean squared error of the Spatial EBLUP*, ISI 2007, LISBOA, 2007.
- MOLINA, I. ; SALVATI, N.; PRATESI, M.  
*Bootstrap for estimating the mean squared error of teh Spatial EBLUP* , SAE 2007 (2nd Conference on Small Area Estimation), PISA, 2007.
- MUÑOZ, A.  
*Monitoring nonlinear profiles using support vector machines* , CIARP 2007, Iberoamerican Conference in Pattern Recognition, Viña del Mar, 2007.
- MUÑOZ, A.  
*Joint Diagonalization of Kernels for information fusion*, CIARP 2007, Iberoamerican Conference in Pattern Recognition, Viña del Mar, 2007.
- MUÑOZ, A.  
*Spectral measures for kernel matrices comparison*, ICANN 2007, International Conference on Artificial Neural Networks, Oporto, PORTUGAL, 2007.
- NIÑO, J.  
*Marginal productivity index policies for scheduling multiclass delay-loss-sensitive traffic with delayed state observation* ; en: Proceedings of the 3rd International Conference on Next Generation Internet Networks-Design and Engineering for Heterogeneity , 2007.
- NIÑO, J.  
*Computing an index policy for bandits with switching penalties* ; en: Proceedings of the Second International Conference on Performance Evaluation Methodologies and Tools. ACM International Conference Proceeding Series , 2007.
- NIÑO, J.  
*Marginal productivity index policies for admission control and routing to parallel multi-server loss queues with reneging* ; en: Proceedings of the First EuroFGI International Conference NET-COOP 2007, Lecture Notes in Computer Science , Springer-Verlag, Berlin, Germany (SV), 2007.
- NIÑO, J.  
*Marginal productivity index policies for scheduling multiclass delay-loss-sensitive traffic with delayed state observation* , NGI 2007, 2nd EuroNGI Conference on Next Generation Internet Networks-Design and Engineering, NORUEGA, 2007.
- NIÑO, J.  
*Marginal productivity index policies for admission control and routing to parallel multi-server loss queues with reneging*, 1st EuroFGI Conference on Network Control and Optimization, NET-COOP 2007, FRANCIA, 2007.
- NIÑO, J.  
*Marginal productivity index policies for scheduling multiclass delay-loss-sensitive traffic with delayed state observation*, Fourth EuroNGI Workshop on New Trends in Modelling, Quantitative Methods and Measurements, BÉLGICA, 2007.
- NIÑO, J.  
*Métodos, formulaciones y algoritmos para la solución de modelos de optimización dinámicos y estocásticos mediante programación matemática*, Jornadas de Seguimiento de Proyectos I+D MTM2004, LOGROÑO, ESPAÑA, 2007.

- NIÑO, J.  
*Characterization and computation of restless bandit marginal productivity indices*, SMCtools 2007, Workshop on Tools for Solving Structured Markov Chains, *NANTES*, 2007.
- NIÑO, J.  
*Computing an index policy for bandits with switching penalties*, SMCtools 2007, Workshop on Tools for Solving Structured Markov Chains, *NANTES*, 2007.
- NIÑO, J.  
*Characterization and computation of restless bandit marginal productivity indices* ; en: ValueTools'07: Proceedings of the Second International Conference on Performance Evaluation Methodologies and Tools. ACM International Conference Proceeding Series, ICST, 2007.
- NOGALES, F. J. ; UPPAL, R.; GARLAPPI, L.; DE MIGUEL, F.V.  
*A generalized approach to portfolio optimization: improving performance by constraining portfolio norms* , *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- PELLEGRINI S. ; RUIZ, E. ; ESPASA, A.  
*The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances*, 62th European meeting of the econometric society, *Budapest*, 2007.
- RAMÍREZ, J. ; LILLO, R. E. ; WIPER, M. P. ; WILSON, S.  
*Inferencia bayesiana para la distribución Doble Pareto Lognormal con Aplicaciones* , XIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- RODRIGUEZ, J.; SANCHEZ, M.J.; GARCIA-MARTOS, C.; ALONSO, A.M.  
*Modelo factorial dinámico con estacionalidad* , XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa, *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- ROMERA, M. R.  
*Ponencia* , 7th Meeting on Game Theory and Practice dedicated to Energy, Environmental and Natural Resources, *MONTREAL*, 2007.
- ROMO, J.  
*Classifying functional observations* , XII International Conference on Applied Stochastic Models and Data Analysis (ASMDA 2007) , 2007.
- ROMO, J.  
*Robust tools for analyzing curves: a depth-based approach* , ICORS07 (International Conference on Robust Statistics), *Buenos Aires*, 2007.
- RUIZ, E. ; CARNERO, M. A. ; PEÑA, D.  
*Estimating underlying volatility in the presence of outliers* , *BUDAPEST*, 2007.
- RUIZ, E. ; PELLEGRINI S. ; ESPASA, A.  
*Conditionally heteroscedastic unobserved component models* , European Meeting of the Econometric Society, *BUDAPEST*, 2007.
- SANCHEZ, I.  
*Statistical time series analysis for wind power prediction* , ISBIS 2007, *ISLAS AZORES*, 2007.
- SANCHEZ, I.  
*Combination of forecasts for wind power prediction*, ISF 2007, *NEW YORK*, 2007.

- VEIGA, M.H.; GRANE, A.  
*Conditional heteroscedasticity or stochastic volatility in financial risk management?*; en: Proceedings of the 22nd international workshop on statistical modelling, ESPAÑA, 2007.
- VELILLA, S.  
*Dimension reduction in classification problems with functional data*, 166th Annual Meeting of the American Statistical Association, *Salt Lake City*, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA, 2007.
- VELILLA, S.  
*Reducción de la dimensión en análisis discriminante cuadrático*, XXX Reunión de la SEIO, *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- WIPER, M. P.  
*Un modelo semiparamétrico para datos circulares*, XXX Congreso de la SEIO, *VALLADOLID*, ESPAÑA, 2007.
- WIPER, M. P.  
*Bayesian software reliability models using metrics information*, Workshop on Mathematical Methodologies for Operational Risk, *EINDHOVEN*, 2007.

## Actividades de cooperación internacional

### Acciones integradas y bilaterales

- ALBARRAN, I.; ALONSO, P. J. ; CARDONE, C. L.  
Sistema financiero argentino, *Universidad Nacional del Litoral y Universidad Carlos III de Madrid*, ARGENTINA. Duración: de 2006 a 2007.  
*Descripción:* Programa Intercampus de Cooperación Científica e Investigación Interuniversitaria entre España e Iberoamérica (PCI). Estudio de las características del sistema financiero argentino

## Actividades de formación y movilidad de personal investigador

### Estancias en otros centros

- ALBA MARIA FRANCO PEREIRA  
*Título:* Estancia de investigación  
*Centro Externo:* Universität Siegen  
*País:* ALEMANIA  
*Duración:* 05/2007 a 07/2007.
- ALBA MARIA FRANCO PEREIRA  
*Título:* Estancia de investigación  
*Centro Externo:* UNIVERSITY OF ARIZONA  
*País:* ESTADOS UNIDOS DE AMERICA  
*Duración:* 07/2007 a 09/2007.
- BERNARDO D AURIA  
*Título:* Estancia de investigación  
*Centro Externo:* The Hebrew University of Jerusalem  
*País:* ISRAEL  
*Duración:* 10/2007 a 11/2007.

- JOSEFA RAMIREZ COBO

*Título:* Wavelets. Procesos multifractales

*Centro Externo:* Department of Biomedical Engineering, Georgia Institute of Technology

*País:* ESTADOS UNIDOS DE AMERICA

*Duración:* 01/03/2007 a 31/08/2007.

## ÁREA DE CONOCIMIENTO: FUNDAMENTOS DEL ANALISIS ECONOMICO

### Publicaciones y actividades de difusión de resultados

#### Artículos en revistas nacionales

- RUIZ, E.  
Entrevista con el Profesor Rob Engle, *Boletín inflación y análisis macroeconómico*, 2007, pp. 64-66, ESPAÑA.

#### Artículos en revistas extranjeras

- ESPASA, A. ; ALBACETE, R.  
Econometric modelling for short-term inflation forecasting in the euro area , *International journal of forecasting*, Vol. 26.5, 2007, pp. 303-316, ESTADOS UNIDOS DE AMERICA.
- RUIZ, E.  
Comments on " Band-limited stochastic processes in discrete and continuous time" by D.S.G. Pollock (Proceedings of the 56th Session of teh ISI), *The Bulletin of the International Statistical Institute*, 2007.

#### Colaboraciones en obras colectivas

- ESPASA, A.  
*Clive Granger: sus semillas en econometría y su visión sobre la construcción de los modelos empíricos en economía*, en: La construcción de modelos empíricos en economía. Version en castellano de C.W.J. Granger, MARCIAL PONS, pp. 1-55, 2007.
- ESPASA, A. ; RODRIGUEZ-POO, J.; VEREDAS, D.  
*Seminonparametric models for financial durations* , en: High frequency financial econometrics. Recent developments, SPRINGER VERLAG, pp. 225-252, 2007.

#### Documentos de trabajo

- CANCELO, J.R.; ESPASA, A. ; GRAFE, R.  
Forecasting from one day to one week ahead for the spanish system operator , *WP 07-84 Serie de Estadística y Econometría. Universidad Carlos III de Madrid*, 2007.
- PELLEGRINI S. ; RUIZ, E. ; ESPASA, A.  
The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances , *Statistics and Econometrics Series WP 07-27*, 2007.

## Ponencias y Comunicaciones a congresos

- CARNERO, M. A. ; PEÑA, D. ; RUIZ, E.  
*Outliers in GARCH models*, International Symposium on Business and Industrial Statistics, *ISLAS AZORES*, 2007.
- PELLEGRINI S. ; RUIZ, E. ; ESPASA, A.  
*The relationship between ARIMA-GARCH and unobserved component models with GARCH disturbances*, 62th European meeting of the econometric society, *Budapest*, 2007.
- RUIZ, E. ; CARNERO, M. A. ; PEÑA, D.  
*Estimating underlying volatility in the presence of outliers* , *BUDAPEST*, 2007.
- RUIZ, E. ; PELLEGRINI S. ; ESPASA, A.  
*Conditionally heteroscedastic unobserved component models* , European Meeting of the Econometric Society, *BUDAPEST*, 2007.
- RUIZ, E. ; PEREZ, A.  
*Stochastic volatility models and the Taylor effect* , 56th Session of the International Statistical Institute (ISI), *LISBOA*, 2007.
- TENA. J.; ESPASA, A. ; PINO, G.  
*Forecasting spanish inflation using information from different sectors and geographical areas* , EcoMod Conference on Regional and Urban Modelling, *BRUSELAS*, 2007.