

**Parte A. DATOS PERSONALES**

|                      |            |
|----------------------|------------|
| <b>Fecha del CVA</b> | 04/11/2021 |
|----------------------|------------|

|                                      |                             |                     |    |
|--------------------------------------|-----------------------------|---------------------|----|
| Nombre y apellidos                   | Emma María Iglesias Vázquez |                     |    |
| DNI/NIE/pasaporte                    | 32827009Y                   | Edad                | 47 |
| Núm. identificación del investigador | Researcher ID               | C-6631-2015         |    |
|                                      | Código Orcid                | 0000-0002-7750-8166 |    |

**A.1. Situación profesional actual**

|                       |                                                    |                    |                                                                |
|-----------------------|----------------------------------------------------|--------------------|----------------------------------------------------------------|
| Organismo             | Universidad de A Coruña                            |                    |                                                                |
| Dpto./Centro          | Departamento de Economía / Fac. Economía y Empresa |                    |                                                                |
| Dirección             | Campus de Elviña s/n 15071, A Coruña               |                    |                                                                |
| Teléfono              | 696592095                                          | correo electrónico | <a href="mailto:emma.iglesias@udc.es">emma.iglesias@udc.es</a> |
| Categoría profesional | Catedrática de Universidad                         | Fecha inicio       | 04/09/2018                                                     |
| Espec. cód. UNESCO    | 5302                                               |                    |                                                                |
| Palabras clave        | Econometría                                        |                    |                                                                |

**A.2. Formación académica (título, institución, fecha)**

| Licenciatura/Grado/Doctorado        | Universidad                        | Año  |
|-------------------------------------|------------------------------------|------|
| Licenciatura en Ciencias Económicas | Universidad de A Coruña (España)   | 1997 |
| MSc in Economics and Econometrics   | University of Exeter (Reino Unido) | 1999 |
| Grado de Licenciada                 | Universidad de A Coruña (España)   | 2000 |
| PhD in Economics                    | Cardiff University (Reino Unido)   | 2002 |

**A.3. Indicadores generales de calidad de la producción científica (véanse instrucciones)**

- Tres sexenios de investigación por la CNEAI: 2000-2005, 2006-2011 y 2012-2017.
- Número de tesis doctorales dirigidas en los últimos 5 años: 1.
- Número de tesis doctorales dirigidas en los últimos 10 años: 4.
- 38 publicaciones en Web of Science, 9 de ellas como único autor y 6 de ellas con mis estudiantes a los que les he dirigido la tesis doctoral. 43 publicaciones en SCOPUS.
- 184 citas totales en Web of Science, 217 en SCOPUS y 706 en Google Scholar (381 desde el año 2016).
- 7 publicaciones Q1: 3 en *Journal of Econometrics*, 1 en *Journal of Business and Economic Statistics*, 1 en *Journal of Applied Econometrics*, 1 en *Journal of Financial Econometrics* y 1 en *Energy Journal*. También 2 en *Econometric Theory*, 4 en *Economic Modelling* y 2 en *Econometric Reviews*.
- h-index: 8 en Web of Science, 9 en SCOPUS y 14 en Google Scholar.
- Clasificación repec: Autores españoles: 193/2087 (top 9%), autores de la Unión Europea: 2882/22690 (top 13%).

**Parte B. RESUMEN LIBRE DEL CURRÍCULUM (máximo 3500 caracteres, incluyendo espacios en blanco)**

- **Mi línea de investigación principal es, en Econometría, el estudio del comportamiento asintótico y en muestras finitas de estimadores y contrastes en modelos de volatilidad de gran aplicación en el campo de las finanzas.**
- Mi trayectoria científica comienza elaborando mi tesis doctoral, y estudiando el comportamiento en muestras finitas de estimadores y contrastes que se aplican a modelos de volatilidad, habitualmente usados en finanzas y macroeconomía. Fruto de ello publiqué varios artículos en revistas importantes como *Econometric Theory*, *Economics Letters* y *Economic Modelling*.
- Al terminar mi tesis en el año 2002, y siguiendo con mi línea de investigación principal, inicié colaboraciones con investigadores importantes en mi área como Jean Marie Dufour (Montreal), Oliver Linton (Cambridge), Christian Dahl (University of Southern Denmark), Bent Jesper Christensen (Aarhus University) y Valentina Corradi (Surrey). Apliqué mi línea de investigación trabajando con estos co-autores a analizar las propiedades de estimadores sobre diversos modelos de volatilidad financieros. Fruto de

ello, he conseguido publicaciones importantes en revistas como el *Journal of Econometrics* y *Econometric Theory*. Actualmente sigo trabajando con dichos coautores.

- Antes de tomar posesión como Catedrática en la Universidad de A Coruña trabajé durante doce años en los Departamentos de Economía de la University of Exeter, Cardiff University, Universidad de Alicante, Michigan State University y la University of Essex como Teaching Assistant, ESRC-Post-doctoral Research Fellow, Assistant Professor y Reader in Economics. Es decir, tengo experiencia docente e investigadora en Universidades de EEUU, Reino Unido y España. Fruto de ello trabajé con co-autores de dichas Universidades, como Jeffrey Wooldridge en *Michigan State University*, donde hemos publicado por ejemplo un artículo en el *Journal of Econometrics* en el 2013 sobre el comportamiento asintótico y en muestras finitas de un estimador máximo verosímil parcial en modelos probit espaciales.
- He dirigido 9 tesis doctorales y con mis alumnos he publicado en revistas como *Journal of Econometrics*, *Energy Journal*, *Economic Modelling*, *International Journal of Finance and Economics*, *Journal of Housing Economics*, *Estudios de Economía* y *Applied Financial Economics*.
- Actualmente tengo vigente 2 proyectos de investigación (en los dos soy investigadora principal, del MINECO y de la Xunta de Galicia) gestionando 207.865 euros.

### **Parte C. MÉRITOS MÁS RELEVANTES (ordenados por tipología)**

#### **C.1. Publicaciones (seleccionadas en los últimos 13 años)**

- 1) CORRADI, V. and E. M. IGLESIAS (2008), Bootstrap Refinements for QML Estimators of the GARCH(1,1) Parameters, *Journal of Econometrics* 144, 500-510.
- 2) CHRISTENSEN, B.J., DAHL, C. M. and E. M. IGLESIAS (2012), Semiparametric inference in a GARCH-in-mean model, *Journal of Econometrics* 167, 2, 458-472.
- 3) IGLESIAS, E. M. and G.D.A. PHILLIPS (2012), Improved Instrumental Variable Estimation of Simultaneous Equations under Conditionally Heteroskedastic Disturbances, *Journal of Applied Econometrics* 27, 474-499.
- 4) IGLESIAS, E. M. and G.D.A. PHILLIPS (2012), Almost Unbiased Estimation in Simultaneous Equations Models with Strong and / or Weak Instruments, *Journal of Business and Economic Statistics* 30, 4, 505-520.
- 5) WANG, H. E. M. IGLESIAS and J. M. WOOLDRIDGE (2013), Partial Maximum Likelihood Estimation of Spatial Probit Models, *Journal of Econometrics* 172, 1, 77-89.
- 6) TOVAR, M. A. and E. M. IGLESIAS (2013), Capital-Energy Relationships: An Analysis when Disaggregating by Industry and Different Types of Capital, *Energy Journal* 34, 4, 129-150.
- 7) IGLESIAS, E.M. (2014), Testing of the Mean Reversion Parameter in Continuous Time Models, *Economics Letters* 122, 2, 187-189.
- 8) IGLESIAS, E.M. (2015), Value at Risk of firms in the main European Union stock market indexes from 2000 until nowadays: a detailed analysis by economic sectors and geographical situation, *Economic Modelling* 50, 1-8.
- 9) IGLESIAS, E. M. and G.D.A. PHILLIPS (2017), The Use of Bias Correction versus the Jackknife when Testing the Mean Reversion and Long term Mean Parameters in Continuous Time Models, *Monte Carlo Methods and Applications* 23, 3, 159-164.
- 10) MAIXÉ-ALTÉS, J. C. and E. M. IGLESIAS (2018), Banking, Currency, Stock Market, and Debt Crises in Spain: 1850-1995, *Applied Economics* 50, 2056-2069.
- 11) IGLESIAS, E. M. and G.D.A. PHILLIPS (2020), Further Results on on Pseudo-Maximum Likelihood Estimation and Testing in the Constant Elasticity of Variance Continuous Time Model, *Journal of Time Series Analysis* 41, 2, 357-364.
- 12) DAHL, C. M. and E. M. IGLESIAS (2021), Asymptotic normality of the QMLE in the level-effect model. *Statistical Papers* 62, 117-135.
- 13) DAHL, C. M. and E. M. IGLESIAS (2022), The Tail Behavior due to the Presence of the Risk Premium in AR-GARCH-in-Mean, GARCH-AR, and Double-Autoregressive-in-Mean Models. *Journal of Financial Econometrics*, forthcoming.
- 14) BRITO-GAONA, L. and E. M. IGLESIAS (2022), Inversión privada, gasto público y presión tributaria en Ecuador. *Revista de Estudios Regionales*, forthcoming.

**C.2. Participación en proyectos de I+D+i (seleccionados en los últimos 10 años)**

1. Referencia del proyecto: **ECO201231459**

Título: VALOR EN RIESGO DE LOS PRINCIPALES INDICES BURSATILES DE LOS PAISES DE LA UNION EUROPEA EN RELACION A ESPAÑA DESDE EL AÑO 2000 HASTA HOY EN DIA

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2013-31/12/2015

Financiación recibida (en euros): 5.499 euros

2. Referencia del proyecto: **GPC2013/072**

Título: AXUDAS DO PROGRAMA DE CONSOLIDACIÓN E ESTRUCTURACIÓN DE UNIDADES DE INVESTIGACIÓN COMPETITIVAS (Grupos de Potencial Crecemento)

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Xunta de Galicia

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2013-31/12/2015

Financiación recibida (en euros): 70.000 euros

3. Referencia del proyecto: **R2014/028 y R2016/047**

Título: REDE DE INVESTIGACIÓN INTERUNIVERSITARIA (DOG.17/10/2014)

Investigador principal (nombre y apellidos): Carlos Hervés Beloso (yo soy coordinadora en la UDC).

Entidad financiadora: Xunta de Galicia

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2014-31/12/2015 y del 01/01/2017-31/12/2018

Financiación recibida (en euros): 240.000 euros

4. Referencia del proyecto: **AGRUP2015/08**

Título: AGRUPACIÓN ESTRATÉGICA GALEGA DE INVESTIGACIÓN EN ANÁLISE ECONÓMICA E ESTRATEXIA EMPRESARIAL

Investigador principal (nombre y apellidos): Carlos Hervés Beloso (yo soy coordinadora en la UDC).

Entidad financiadora: Xunta de Galicia

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2015-31/12/2017

Financiación recibida (en euros): 500.000 euros

5. Referencia del proyecto: **ECO2015-63845\_P**

Título: ESTIMACIÓN Y CONTRASTES EN MODELOS DE DIFUSIÓN EN TIEMPO CONTINUO

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2016-31/12/2018

Financiación recibida (en euros): 4.700 euros

6. Referencia del proyecto: **ED431C2016/007**

Título: AXUDAS DO PROGRAMA DE CONSOLIDACIÓN E ESTRUCTURACIÓN DE UNIDADES DE INVESTIGACIÓN COMPETITIVAS (Grupos de Referencia Competitiva)

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Xunta de Galicia

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2016-31/12/2019

Financiación recibida (en euros): 400.000 euros

7. Referencia del proyecto: **PGC2018-101327-B-100**

Título: Nuevos modelos de volatilidad y análisis de los valores extremos y de su comportamiento en las colas. Investigadora principal

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2019-30/09/2022

Financiación recibida (en euros): 7.865 euros

8. Referencia del proyecto: **ED431C2020/26**

Título: AXUDAS DO PROGRAMA DE CONSOLIDACIÓN E ESTRUCTURACIÓN DE UNIDADES DE INVESTIGACIÓN COMPETITIVAS (Grupos de Referencia Competitiva)

Investigador principal (nombre y apellidos): Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: Xunta de Galicia

Duración (fecha inicio - fecha fin, en formato DD/MM/AAAA): 01/01/2020-31/12/2023

Financiación recibida (en euros): 200.000 euros

**C.3. Contratos, méritos tecnológicos o de transferencia**

1. Referencia del contrato: **CT-EX2013D152024-101**

Título: Expert contract. Investigador principal: Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: European Commission. Duración: 10/10/2016-09/12/2016

Financiación recibida (en euros): 2.025 euros

2. Referencia del contrato: **CT-EX2013D152024-102**

Título: Expert contract. Investigador principal: Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: European Commission. Duración: 09/10/2017-31/12/2017

Financiación recibida (en euros): 2.430 euros

3. Referencia del contrato: **CT-EX2013D152024-103**

Título: Expert contract. Investigador principal: Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: European Commission. Duración: 05/10/2018-02/02/2019

Financiación recibida (en euros): 945 euros

4. Referencia del contrato: **CT-EX2013D152024-104**

Título: Expert contract. Investigador principal: Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: European Commission. Duración: 01/10/2019-05/01/2020

Financiación recibida (en euros): 1.935 euros

5. Referencia del contrato: **CT-EX2013D152024-105**

Título: Expert contract. Investigador principal: Emma María Iglesias Vázquez

Entidad financiadora: European Commission. Duración: 02/10/2020-04/01/2021

Financiación recibida (en euros): 1.575 euros

**C.4. Patentes**

**C.5. Associate Editor de Revistas con JCR y en SCOPUS**

- *Associate Editor de Applied Economics, Applied Financial Economics* (incorporado a *Applied Economics* actualmente) y *Applied Economics Letters* desde el 2011 hasta hoy en día. Guest Editor de un special issue en "*Applied Economics*" con el Catedrático J. Carrion i Silvestre de la University of Barcelona en el 2013.

**C.6. Tareas de evaluación**

- Referee para más de 100 artículos incluyendo *Econometrica*.

**C.7. Gestion de la actividad científica**

- Organizadora del XV *Encuentro de Economía Aplicada*, A Coruña, 7-8 Junio, 2012.
- Coordinadora del grupo Competencia e Desarrollo (C+D Group) de la UDC desde Noviembre del 2015 hasta hoy en día. Coordinadora del programa de doctorado interuniversitario de Economía y Empresa del 2014 hasta hoy en día.

**C. 8. Estancias de Investigación, congresos, conferencias y seminarios por invitación.**

- He realizado estancias de investigación en la London School of Economics, University of Montreal y CREATES (Center for Research in Econometric Analysis of Time Series) en Aarhus University. He presentado artículos en numerosos congresos nacionales e internacionales (como los de la *Econometric Society*), y en seminarios por invitación en muchas Universidades como Harvard/MIT e instituciones financieras como la Federal Reserve Bank of St. Louis. En total, he realizado más de 100 presentaciones académicas. He sido invitada a dar cursos de doctorado y Master en Universidades como la Carlos III de Madrid. En <https://pdi.udc.es/es/File/Pdi/636JF> se pueden ver más detalles.

**C. 9. External examiner y miembro de paneles de expertos**

- External Examiner en el Departamento de Economía de la University of Reading (UK) de los *Bachelors of Science de Economics and Joint Programmes; Accounting and Economics; Business Analysis y Business Economics* durante los cursos académicos 2010/2011 y 2012/2015.
- Member of an international review panel of the Danish Council for Independent Research | Social Sciences. March 1-2, 2016, January 7-8, 2017 y January 9-11, 2018.
- Miembro del panel de expertos de la European Commission, Sept.-Dic. 2016, Sept.-Dic. 2017, Sept.-Dic. 2018, Sept.-Dic. 2019, Sept.-Dic. 2020 y Nov 2021-Enero 2022.
- Miembro del panel de expertos de la Agencia Española de Investigación (2014, 2017, 2019 y 2021) para evaluar proyectos de I+D de retos y excelencia.

**C.10. Dirección de tesis doctorales en los últimos 10 años (entre paréntesis figura el número de publicaciones que fueron obtenidas de cada tesis doctoral)**

- Doctorando: Luis Felipe Brito-Gaona. Defensa en la *Universidad de A Coruña* el 26 Febrero, 2018. Título: “Inversión privada, gasto público y presión tributaria”. Posición actual: Profesor Titular, *Universidad Técnica de Machala*, Ecuador. (1 en JCR y 3 en SCOPUS)
- Doctorando: Miguel Angel Tovar. Defensa en *University of Essex* el 31 Mayo, 2012. Título: “Energy and Capital Relationships in the United Kingdom”. Posición actual: Research Associate, *Centre for European Economic Research (ZEW)*, Alemania. (3 en JCR)
- Doctorando: Andre Haughton. Defense at *University of Essex*: April 19, 2011. Title: “Effects of Currency Unions”. Posición actual: Assistant Professor, *University of the West Indies Mona*, Jamaica. (2 en JCR y 1 en SCOPUS)
- Doctorando: Fathin Faizah Said. Defense at *University of Essex*: March 8, 2011. Title: “Basel II and Financial of Consumer or Corporate Loans”. Trabajo actual: Senior Lecturer, *National University of Malaysia*, Malaysia. (1 en JCR y 1 en SCOPUS)