

CURRICULUM VITAE

INFORMACION PERSONAL

Nombre: M^a del Pilar Poncela Blanco

Dirección: Depto. Análisis Económico: Economía Cuantitativa. Universidad Autónoma de Madrid. Campus de Cantoblanco. Av. Tomás y Valiente, 5. 28049 Madrid ESPAÑA
+34 914975521

e-mail pilar.poncela@uam.es

EXPERIENCIA PROFESIONAL

- (1998-) Universidad Autónoma de Madrid, España.

Durante 2016-2019 en situación de servicios especiales como investigador senior en la Comisión Europea, Centro Común de Investigación (DG Joint Research Centre), Ispra, Italia.

Desde 2019, Catedrático de Universidad

- (1992-1998) Universidad Carlos III de Madrid, España.
- (1991-1992) Ingeniero en prácticas, Philips-Whirlpool, Norköping, Suecia.

EDUCACIÓN

- Visiting scholar, Graduate School of Business, University of Chicago, 1998.
- 1998, Doctor en Economía, Universidad Carlos III de Madrid, España. Cum Laude por unanimidad. Director de tesis: Daniel Peña.
- 1991, Ingeniero Industrial, Escuela Técnica Superior de Ingeniería Industrial, Universidad de Valladolid, España. Matrícula de Honor en el proyecto fin de carrera. Reconocido como Máster en el Marco Español de Cualificaciones para la Educación Superior.

CARGOS ACADÉMICOS

- (2015-) **Director**, International Institute of Forecasters (IIF) <http://forecasters.org/>, con sede en Boston (USA).
- (2020-) Directora del Máster en Análisis Económico Cuantitativo, Universidad Autónoma de Madrid.
- (2019-) Miembro electo de la Junta de Facultad. Representante de profesores permanentes.
- (2012-2014) Coordinador del grado en Economía y Finanzas (bilingüe).
- (2014-2016) Directora del dep. de Análisis Económico: Economía Cuantitativa.
- (2005-2010) Subdirectora del dep. de Análisis Económico: Economía Cuantitativa.
- (2010-2011) Miembro del Comité de Evaluación de las Becas de Formación del Personal Universitario (FPU). Ministerio de Educación.
- (2011-2016) Miembro electo de la Junta de Facultad, representante de profesores permanentes, Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.
- (2012-2016) Miembro de la Comisión de Estudios de Grado de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.
- (2012-2016) Miembro de la Comisión de la Garantía Interna de la Calidad de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.
- (2012-2013) Miembro de la Comisión de Investigación de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.
- (1999-2001) Miembro electo de la Junta de Facultad, representante de Ayudantes de Universidad, Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.

PUBLICACIONES

Capítulos de libro (internacionales)

1. "Johansen's procedure", (2004) en C. Rodríguez-Braun y J. Segura (eds.). An Eponymous Dictionary of Economics, Edward Elgar.
2. "Dimension reduction in multivariate time series" (2006) con D. Peña, in Advances in Distribution Theory, order statistics and inferences, Balakrishnan, Castillo y Sarabia (editores), 433-458. Editorial Birkhäuser.
3. "Green Shoots?: Where, When and How?" (2010) con M. Camacho y G. Pérez-Quirós, in FEDEA Annual Policy Monograph on The Crisis of the Spanish Economy.
4. More is not always better: back to the Kalman filter in Dynamic Factor Models (2015) con E. Ruiz, in "Unobserved Components and Time Series Econometrics", N. Shephard y S.J. Koopman editors. Editorial: Oxford University Press.
5. "Small versus big-data factor extraction in Dynamic Factor Models: An empirical assessment" (2016) con E. Ruiz, in Advances in Econometrics, E.T. Hillebrand y S. J. Koopman (editors), volume 35, 401-434.
6. "Strong Separability in Circulant SSA" (2018) con J. Bógalo y E. Senra, Nonparametric Statistics. Editors: Bertail, P., Cornillon, P.-A., Matzner-Lober, E., Blanke, D. Editorial: Springer.

En revistas internacionales

7. "Measuring intervention effects on multiple time series subjected to linear restrictions: A banking case" (1998), con Víctor Guerrero y Daniel Peña. Journal of Business and Economic Statistics, **16**, 489-498.
8. "Data graduation based on statistical time series methods" (2001), con V. Guerrero y R. Juárez, Statistics and Probability Letters, **52**, 169-175.
9. "Forecasting European GNP data through common factor models and other procedures" (2002), con A. García-Ferrer, Journal of Forecasting, **21**, 225-244.
10. "Forecasting nonstationary dynamic factor analysis" (2004), con Daniel Peña, Journal of Econometrics, **119**, 291-321.

PREMIO Consolidar a publicaciones en revistas de excelencia.

11. Review of the book Time series analysis by state space methods (Durbin y Koopman). (2004) International Journal of Forecasting, **20**, 139-141.
12. "Forecasting public transportation in large cities", (2004) con A. García-Ferrer, A. de Juan y M. Bujosa. Journal of Transportation and Statistics **7**, 39-59.
13. "Introduction to nonlinearities, business cycles, and forecasting", Editorial (2005) con A. García-Ferrer, Jan G. De Gooijer, y E. Ruiz. International Journal of Forecasting, **21**(4), 623-625.
14. "Joint Forecasts of European Fertility Rates con Non-Stationary Dynamic Factor Models" (2005), con Ortega-Osona, J. A. International Journal of Forecasting **21**, 539-550.
15. "Demand forecast and elasticities estimation of public transport" (2005), con M. Bujosa, A. García-Ferrer y A. de Juan, Journal of Transport Economics and Policy **40**, 45-67.

16. "Nonstationary dynamic factor models", (2006) con D. Peña. *Journal of Statistical Planning and Inference* **136**, 1237-1257.
 17. "A Two Factor Model to Combine US Inflation Forecasts", (2006) con E. Senra. *Applied Economics* **38**, 2191-2197.
 18. "Forecasting traffic accidents using disaggregated data" (2006) con A. García-Ferrer, y A. de Juan, *Int. Journal of Forecasting*, **22**, 203-222.
 19. "The relationship between road traffic accidents and real economic activity in España: Common cycles and health issues" (2007) con A. García-Ferrer y A. de Juan. *Health Economics*, **16**, 603-626.
 20. "Forecast Combination through Dimension Reduction Techniques" (2011) con J. Rodríguez, R. Sánchez-Mangas y E. Senra. *International Journal of Forecasting*, **27**, 224-237.
 21. "Further research on independent component analysis", (2012). *International Journal of Forecasting*, **28**, 94-96.
 22. "Automatic tuning of Kalman filters by maximum likelihood methods for wind energy forecasting" (2013) con M. Poncela y J.R. Perán. *Applied Energy*, **108**, 349–362.
 23. "Comments on "Forecasting the US term structure of interest rates using a macroeconomic smooth dynamic factor model" by Koopman and van der Wel" (2013). *International Journal of Forecasting*, **29**, 695-697.
 24. "Short-term Forecasting for Empirical Economists: A Survey of the Recently Proposed Algorithms" (2013) con M. Camacho and G. Perez-Quiros. *Foundations y Trends@ in Econometrics*, Vol. 6, No. 4, 337–397.
 25. "Combining Mexico's monthly inflation predictions from a professional forecasters survey" (2014), con V. Guerrero, A. Islas, J. Rodríguez y R. Sánchez-Mangas. *CEPAL Review* **113**, 75-87.
 26. "Green shoots and double dips in the Euro area. A real time measure" (2014) con M. Camacho y G. Perez-Quiros. *International Journal of Forecasting* **30** (3), 520-535.
 27. "Some New Results on the Estimation of Structural Budget Balance for España" (2014) con G. Zack, E. Senra y D. Sotelsek. *Review of Public Economics* **210** (3), 11-31.
 28. "The effects of disaggregation on forecasting nonstationary time series" (2014), con A. García-Ferrer. *Journal of Forecasting* **33** (4), 300-314.
 29. "The dynamics of co-movement and the role of uncertainty as a driver of non-energy commodity prices" (2014) con L. Sierra y E. Senra. *Applied Economics* **46** (30), 3724-3735.
- PREMIO** al mejor documento de trabajo 2013 de FUNCAS (Fundación Cajas de Ahorros).
30. "Sparse Partial Least Squares in Time Series for Macroeconomic Forecasting" (2015), con J. Fuentes y J. Rodríguez. *Journal of Applied Econometrics* **30** (4), 576-595.
 31. "Extracting nonlinear signals from several economic indicators" (2015), con M. Camacho y G. Perez-Quiros. *Journal of Applied Econometrics* **30** (7), 1073-1089.
 32. "Choosing a Dynamic Common Factor As a Coincident Index" (2016) con W. Martínez y F. Nieto. *Statistics and Probability Letters* **109**, 89-98.

33. "Long-term links between raw materials prices, real exchange rate and relative de-industrialization in a commodity-dependent economy: Empirical evidence of 'Dutch disease' in Colombia" (2017) con L. Sierra y E. Senra, *Empirical Economics* **52**, 777-798.
34. "A new look at oil price pass-through into inflation: Evidence from disaggregated European data" (2017), con C. Castro, R. Jiménez-Rodríguez y E. Senra. *Economía Política, Journal of Analytical and Institutional Economics* **34**, 55–82.
35. "Determining the number of factors after stationary univariate transformations" (2017), con F. Corona y E. Ruiz. *Empirical Economics* **53**, 351–372.
36. "Measuring uncertainty and assessing its predictive power in the Euro zone" (2017) con E. Senra. *Empirical Economics* **53**, 165-182.
37. "Markov-switching dynamic factor models in real time" (2018), con M. Camacho y G. Pérez-Quirós. *International Journal of Forecasting* **34**, 598-611.
38. "A review of international risk sharing for policy analysis" (2019) con M. Nardo y F. Pericoli. *East Asian Economic Review* **23**, 227-260.
39. "Estimating non-stationary common factors: Implications for risk sharing" (2020) con F. Corona, E. Ruiz, *Computational Economics* **55**, 37–60.
40. "A fragmented-periodogram approach for clustering big data financial time series" (2020) con J. Caiado y N. Crato. *Advanced Data Analysis and Classification* **14**, 117–146.
41. "Global vs sectoral factors and the impact of the financialization in commodity price changes" (2020) con E. Senra y L. Sierra. *Open Economies Review* **31**, 859–879.
42. "Circulant Singular Spectrum Analysis to monitor the state of the economy in real time" (2021), con J. Bógalo, y E. Senra. *Mathematics*, **9** (11), 1169; <https://doi.org/10.3390/math9111169>.
43. "Circulant Singular Spectrum Analysis: A new automated procedure for signal extraction" (2021) con J. Bógalo, y E. Senra. *Signal Processing* **179**, 107824 (<https://doi.org/10.1016/j.sigpro.2020.107824>).
44. "Factor extraction using Kalman filter and smoothing: This is not just another survey" (2021) con K. Miranda y E. Ruiz. *International Journal of Forecasting* **37**, 4, 1399-1425.
45. "Dynamic Factor Models: Does the specification matter?" (2021) con K. Miranda y E. Ruiz. *SERIEs* (aceptado).

Otras publicaciones

46. "Nuevos Métodos de Análisis de la Coyuntura" (2001) con A. García-Ferrer, *Moneda y Crédito*, nº **212**, 95-153.
47. "Do interrelated financial markets help in forecasting stock returns?" (2003) con A. García-Ferrer y M. Bujosa. *Cuadernos de Economía*, **26**, 83-103.
48. *Predicciones de la demanda y recaudaciones y recaudaciones y estimación de las elasticidades del transporte público en el Área Metropolitana de Madrid*, con A. García-Ferrer, M. Bujosa y A. de Juan. Editorial: Compañía Española de Reprografía y Servicios (libro completo).

49. "Do we see the effects of oil variations in official statistics price data?" (2011) con Castro, C., y E. Senra. *BEIO*, **27**, 29-41.
50. "Nuevos Modelos de predicción eólica basados en series temporales" (2014) con M. Poncela y J. Perán. *EOLUS*, **68**, 36-40.
51. "Éxitos y retos de big data en análisis económico: un recorrido a través de ejemplos" (2021) con E. Senra. En *Análisis econométrico y big data*, Daniel Peña, Pilar Poncela y Esther Ruiz (editores). FUNCAS. <https://www.funcas.es/libro/analisis-econometrico-y-big-data-2/>
52. Editorial *Nuevos métodos de predicción económica con datos masivos* (2020) Daniel Peña, Pilar Poncela y Esther Ruiz (editores). FUNCAS
53. Editorial *Análisis econométrico y big data*, (2021) Daniel Peña, Pilar Poncela y Esther Ruiz (editores). FUNCAS. <https://www.funcas.es/libro/analisis-econometrico-y-big-data-2/>

Documentos de trabajo. Trabajos en curso

54. "Selecting and combining experts from survey forecasts" (2014) con J. Fuentes, y J. Rodríguez, UC3M Working papers. Statistics and Econometrics 14-05.
55. "Risk Sharing in Europe" (2016) con F. Pericoli, A. Manca y M. Nardo. European Commission, Joint Research Centre, *Policy Report*.
56. "Risk Sharing among European countries" (2017) con M. Nardo y F. Pericoli. European Commission, Joint Research Centre, *Technical Report*.
57. "Country Heterogeneity for Risk Sharing" (2018) con P. Asdrubali, S.Y. Kim y F. Pericoli. European Commission, Joint Research Centre. JRC Working Papers in Economics and Finance, 2018/13.
58. "A comment on the dynamic factor model with dynamic factors" (2020) con E. Ruiz. *Economics*, Discussion Paper 2020-7.
59. "Multivariate Circulant Singular Spectrum Analysis" (2020) con J. Bógalo, y E. Senra. WP.

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN

Investigador principal de los siguientes proyectos

- Nuevos métodos de predicción macroeconómica y análisis de políticas públicas. Convocatoria 2019. Ref PID2019-108079GB-C22. Entidad financiadora: Ministerio de Ciencia e Innovación. Cantidad financiada: 34969€
- Análisis de actividad económica mediante indicadores y evaluación de políticas públicas. Convocatoria 2015. Ref ECO2015-70331-C2-1-R. Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad.
- Investigadora Principal del Proyecto Coordinado AEEyEPP. Entidades participantes: Universidad Autónoma de Madrid (Ref ECO2015-70331-C2-1-R) / Universidad Carlos III de Madrid (Ref ECO2015-70331-C1-1-R). Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad.

- ¿Se pueden mejorar las predicciones de población en México? Combinación de predicciones socioeconómicas. 2011-2012. Entidad financiadora: Universidad Autónoma de Madrid/Banco Santander.
- Proyecto CCG06-UAM/HUM-0452. Predicción de series económicas mediante técnicas de reducción de la dimensión aplicación a series de la Comunidad de Madrid. Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.
- Proyecto 06/HSE/0016/2004. Factores determinantes de la inflación regional en España. Un análisis sectorial de la Comunidad de Madrid. Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.

Investigador

- CC-ECHASS: CLIMATE CHANGE AND ECONOMIC CHALLENGES FOR THE SPANISH SOCIETY. Convocatoria 2021-2022. IP: Esther Ruiz. Entidad financiadora: Fundación La Caixa. Financiación: 100000€.
- Análisis de actividad económica mediante indicadores y evaluación de políticas públicas. Convocatoria 2015. Ref ECO2015-70331-C2-1-R. Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad.
- ¿Se pueden mejorar las predicciones de población en México? Combinación de predicciones socioeconómicas. Cofinanciado UAM/Banco Santander.
- Proyecto Ref: ECO2012- 32854. Nuevos métodos de predicción para datos macroeconómicos y financieros utilizando modelos factoriales dinámicos e indicadores adelantados de actividad. Financiación: 22000€. Programa: Ministerio de Ciencia e Innovación.
- Proyecto Ref: ECO2009-10287. Nuevos métodos para la selección de indicadores económicos adelantados en la estimación y predicción de modelos factoriales multivariantes. Financiación: 68970€. Programa: Ministerio de Ciencia e Innovación.
- Proyecto Ref: SEJ2006-04957. Modelos no estacionarios de factores dinámicos y modelos ica: identificación, estimación y predicción de series económicas multivariantes. Financiación: 102003€. Programa: Ministerio de Ciencia e Innovación.
- Proyecto Ref: 09/SHD/011. Predicción estocástica de la población: Nuevos algoritmos de estimación y aplicaciones económicas. Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.
- Proyecto Ref: BEC2002-00081. Modelos de control estocástico de procesos y creación de un sistema de previsión y seguimiento de los indicadores de accidentes por carretera. Programa: Ministerio de Ciencia y Tecnología.
- Predicciones de la demanda y recaudaciones y estimación de las elasticidades del transporte público en el Área Metropolitana de Madrid. Programa: Comunidad de Madrid.
- Proyecto Ref: PB98-0075. Alternativas univariantes y multivariantes a la formulación de modelos de tendencia para la detección y predicción de puntos de cambio: Aplicaciones económicas y algoritmos Estadísticos. Programa: Ministerio de Ciencia y Tecnología.
- Proyecto Ref: PB94-0374. Algoritmos para la detección de atípicos y análisis de conglomerados en grandes masas de datos. Financiación: 33055,66€. Programa: Dirección General de Investigaciones Científicas.

PREMIOS Y BECAS

- FUNCAS (Fundación Cajas de Ahorros), Premio al mejor documento de trabajo 2013.
- Fellowship, Banco of España, 2009.
- Premio Consolidar a publicaciones en revistas de excelencia.
- SAS-International Institute of Forecasters Grant 2005.
- Premio Extraordinario de Doctorado, Universidad Carlos III de Madrid.
- Beca de la Fundación Carlos III, 1998.
- Beca COMMET, Asociación Robótica Española, 1991.
- Beca del departamento de Automática, Universidad de Valladolid, 1989-1991.

ESTANCIAS EN OTRAS INSTITUCIONES

- 1998 (7 meses) Visiting scholar, Graduate School of Business, University of Chicago (USA).
- 2009 (9 meses) Visiting fellow, Banco de España.
- 2012 (1 semana) Instituto Tecnológico Autónomo de México, ITAM, (México).
- 2014 (1 mes) Cass Business School, London (UK).
- 2014 (1 semana) Universidad Nacional de Colombia, sede Bogotá, (Colombia).
- 2014 (1 semana) Pontificia Universidad Javeriana de Cali, (Colombia).
- 2016-2019 (3 años) Comisión Europea, Centro Común de Investigación, Ispra (Italia).

ACTIVIDAD EDITORIAL

- **Editor Asociado**, *Journal of Time Series Analysis*, 2013-2019.
- **Editor** Invitado del número especial *International Journal of Forecasting*, 21(4): Nonlinearities, Business Cycles and Forecasting.
- **Editor FUNCAS**
- **Evaluador de las siguientes revistas:** *Journal of the American Statistical Association*, *International Journal of Forecasting*, *Journal of Forecasting*, *Journal of Time Series Analysis*, *Technometrics*, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, *Journal of the Royal Statistical Society Series A*, *European Economic Review*, *Macroeconomic Dynamics*, *Journal of Money, Credit and Banking*, *Clometrica*, *Journal of Geographical Systems*, *Mathematics and Computers in Simulation*, *Communications in Statistics*, *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, *Empirical Economics*, *Journal of Financial Econometrics*, *Econometric Reviews*, *Journal of Multivariate Analysis*, *Computational Statistics and Data Analysis*, *Computational Statistics*, *Computational Economics*, *Journal of Applied Statistics*, *Studies in Nonlinear Dynamics and Economics*, *Emerging Markets Finance and Trade*, *International Journal of Computational Economics and Econometrics*, *Applied Economics*, *Decisions in Economics and Finance*, *TEST*, *Spanish Economic Review*, *CEPAL Review*, *Brazilian Journal of Political Economy*, *Estadística*, *Revista de Economía Aplicada*, *Investigaciones Económicas*, *SERIEs*, *Revista Colombiana de Estadística*, *Banco de España Working Papers Series*.
- **Evaluador de proyectos de la Agencia Nacional de Evaluación y Prospectiva** (ANEP).

PRESENTACIÓN EN CONFERENCIAS

Internacionales

- "Nonstationary Dynamic Factor Models", Joint Statistical Meeting, Dallas, USA, 1998
- "Nonstationary Dynamic Factor Models", 1998 NBER Meeting, Chicago, USA, 1998.
- "Forecasting international GNP data through common factor models and other procedures", XIX ISF, Washington, USA, 1999.
- "Modeling Inflation: Experience with US and Spanish Data", XVII Latin American Meeting of the Econometric Society, Cancún, México, 1999.
- "Can we find globalization in financial stock markets?" XX ISF, Lisbon, 2000.
- "A seasonal factor model for a leading indicator approach" XXI ISF, Atlanta, 2001.

- "Studying the difference between univariate and factor models in terms of forecasting. An application to economic data". 5th Time Series Arrabida Workshop, Portugal, 2001.
- "Macroeconomic Forecasting with Dynamic Models", ASSET Conference, Creta, Grecia, 2001.
- "Joint Forecasts of Southern European Fertility Rates with Non-Stationary Dynamic Factor Models", Workshop on Lowest Low Fertility in Southern Europe, Max Planck Institute for Demographic Research, Rostock, Germany, 2002.
- "Forecasting Monthly US Consumer Price Indexes Through a Disaggregated I(2) Analysis", 57th European Econometric Society Meeting, Venice, Italy, 2002.
- "A factor approach to combine forecasts" 23 ISF, Mérida, México, 2003.
- "The effects of disaggregation on nonstationary I(1) time series" 23 ISF, Mérida, México, 2003.
- "A system to control and forecast road accidents" 23 ISF, Mérida, México, 2003.
- "Nonstationary dynamic factor analysis", Econometric Time Series Analysis, Linz, Austria, 2003.
- 2005 NBER/NSF Time Series Conference, "Identification in nonstationary dynamic factor models: Applications for forecast combinations" Heidelberg, Alemania.
- 2005 ASSET Conference. "Dynamic factor analysis"
- "The relationship between road traffic accidents and real economic activity in España: Common cycles and health issues" 27 ISF, 2007, NY, US.
- "Combination of forecasts by factor models" ISI Meeting, Lisbon, Portugal, 2007.
- "Forecast combination through dimension reduction techniques" 28 ISF, 2008, Nice (France).
- "Forecast combination through dimension reduction techniques" European Econometric Society, 2008, Milano, (Italy).
- "Markov Switching Dynamic Factor Models in Real Time" 29 ISF, 2009, Hong Kong (China).
- "Markov Switching Dynamic Factor Models in Real Time" 2009 ASSET Conference, Istanbul (Turkey).
- Structural vs. Non-structural Multivariate Macroeconomic Forecasting", 30 ISF San Diego, (EEUU), 2010.
- "Markov Switching Dynamic Factor Models in Real Time", Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics 18th Annual Symposium, 2010, Novara, Italy.
- "A comparison of sparse methods for factor forecasting", CFE-ERCIM 2010, London, UK, 2010.
- "The effects of disaggregation on forecasting nonstationary time series", 31 ISF, Prague (Czech Republic), 2011.
- "Markov Switching Dynamic Factor Models in Real Time", European Econometric Society Meeting, Oslo, Norway, 2011.
- "Markov Switching Dynamic Factor Models in Real Time" ERCIM 2011, London, UK.
- "More is not always better: back to the Kalman filter in Dynamic Factor Models", 32 ISF, Boston (USA), 2012.
- "The effects of disaggregation on nonstationary I(1) time series", European Econometric Society, Málaga 2012.
- "An empirical assessment about the number of series for factor estimation", 33 ISF, Seoul, (Korea), 2013.
- "Dimensionality: curse or blessing? An empirical assessment when estimating factors in Dynamic Factor Models", 36 ISF, Rotterdam, Holanda, June 2014.
- "Dimensionality: curse or blessing? An empirical assessment when estimating factors in Dynamic Factor Models", with E. Ruiz, Advances in Econometrics Conference on Dynamic Factor Models, Aarhus, Dinamarca, Nov 2014.
- "Forecasting volatility measures through dynamic factor models of realized measures", CFE-ERCIM 2014, Pisa, Italy, 6-8 Dec, 2014.
- Circulant SSA" with J. Bógalo and E. Senra, Int Society of Non Parametric Statistics June 2016, Avignon (Francia).
- "Circulant SSA" with J. Bógalo and E. Senra, International Symposium on Forecasting, ISF June 2016, Santander (España).
- "Risk sharing through heterogeneous panel VARs" with F. Pericoli and E. Rossi, International Symposium on Forecasting, ISF June 2017, Cairns (Australia).

- “Risk Sharing Channels in OECD Countries: a Heterogeneous Panel VAR Approach” with P. Asdrubali, S. Kim and F. Pericoli, International Symposium on Forecasting, ISF June 2018, Boulder, Colorado (USA).
- Kick-off seminar CAS, European Commission, Joint Research Centre, May 2018, Ispra (Italia).
- “Risk Sharing Channels in OECD Countries: a Heterogeneous Panel VAR Approach” with P. Asdrubali, S. Kim and F. Pericoli, Applied Economics Meeting, June 2018, Alcalá de Henares, Madrid (Spain).
- “Estimating non-stationary common factors: Implications for risk sharing” with F. Corona, E. Ruiz, EEA-ESEM 2018, Cologne (Germany).
- “New Risk Sharing Channels in OECD Countries: a Heterogeneous Panel VAR Approach” con P. Asdrubali, S. Kim and F. Pericoli, IEFS-EAER 2019 Conference Seoul, (Corea del Sur).
- “Disentangling common and idiosyncratic components through Multivariate Circulant SSA (M-CiSSA)”, con J. Bógalo y E. Senra, ISF-2020 (Virtual). Octubre 2020.
- “New Risk Sharing Channels in OECD Countries: a Heterogeneous Panel VAR Approach” con P. Asdrubali, S. Kim and F. Pericoli, ERCIM-CFE 2020 (Virtual). Diciembre 2020.
- “Dynamic Factor Models: Does the specification matter? (2021)” con E. Ruiz y K. Miranda, ISF2021 (Virtual), June 2021.

Nacionales

- "Combinación de información en modelos de series temporales", Sociedad Española de Estadística e Investigación Operativa, SEIO. Valencia, 1997.
- "Pooling information and forecasting with dynamic factor models". XXII Simposio de Análisis Económico. Barcelona, 1997.
- "Forecasting consumer price index through a I(2) disaggregated analysis ". XXII Simposio de Análisis Económico. Alicante, 2001.
- "The effects of disaggregation on forecasting nonstationary time series" XXXV Simposio de Análisis Económico. Alicante, 2010.
- "Sparse PLS for macroeconomic forecasting". IIIrd Workshop in Time Series. Zaragoza, 2013.
- "Dimensionality reduction on time series modelling and computation" First Meeting on Time Series. Universidad Carlos III de Madrid, 2013.

SEMINARIOS, PONENCIAS PLENARIAS Y CURSOS CORTOS IMPARTIDOS

- Universidad Pompeu-Fabra, (España), 1998.
- Universidad de Alicante, (España), 1998.
- Dep. Economía Aplicada, Universidad de Vigo, (España), 2001.
- Summer Course Universidad de Cádiz "Series Temporales aplicadas al Medio Ambiente" Cádiz, (España), 2000, 2001.
- CARTIF, 2002, 2008, Valladolid, (España).
- Universidad Carlos III de Madrid, (España), 2003, 2012.
- Discussant of “GICA-GARCH models with applications to financial stock returns”, IIF Workshop on Financial Time Series, Lisbon, (Portugal) 2009.
- University of Leuven, (Belgium), 2011.
- Universidad del País Vasco, (España), 2011.
- Universidad de Murcia, (España), 2011.
- Banco de España, 2009, 2012.
- Congreso Nacional de Estadística, Santa Marta, (Colombia), 2011. (Keynote speaker).
- Discussant of “Forecasting the US Term Structure of Interest Rates using a Macroeconomic Smooth Dynamic Factor Model” by Koopman y van der Wel, IIF Workshop on Flash Indicators, Verbier, (Switzerland), 2011.
- ITAM, Mexico DF, (Mexico) 2012.
- Discussant of “Short-term GDP forecasting with a mixed frequency dynamic factor model with stochastic volatility” by Marcellino, Porqueddu y Venditti. Workshop on Uncertainty and Forecasting in Macroeconomics 2012, Training Centre of the Deutsche Bundesbank, Eltville (Alemania).

- Universidad Complutense de Madrid, 2013.
- Universidad de Zaragoza, 2013.
- Pontificia Universidad Javeriana de Cali, (Colombia), 2014.
- Universidad Nacional de Colombia, sede Bogotá, (Colombia), 2014.
- Universidad de Salamanca, (España), 2015.
- Universidad de las Islas Baleares, (España), 2015.
- Universidad Internacional Menéndez Pelayo, 2015.
- Workshop on forecasting economic time series In honour of A. Espasa, Universidad Carlos III de Madrid, (España), June 2015.
- European Commission, Joint Research Centre, Ispra (Italy), 2016, 2018.
- European Commission, DG FISMA, "The Knowledge Hour", Brussels (Belgium), 2016.
- "Risk-sharing in Europe", Banco de España, Madrid (España), 2017.
- "A Primer in Dynamic Factor Models", European Commission, Ispra (Italia)-Brussels (Bélgica)- Sevilla (España), 2019.
- Waseda University (Tokio, Japón), 2019.
- European Central Bank, Frankfurt, Germany, 2019.
- FUNCAS, Jornadas sobre Análisis Económico y Big Data, 2020.
- Universidad Complutense de Madrid, 2007, 2021.

ORGANIZACIÓN DE CONFERENCIAS, PARTICIPACIÓN EN COMITÉS CIENTÍFICOS

- Organizadora de la Forecasting Summer School del International Institute of Forecasters, correspondientes a las ediciones de 2018 (Boulder, EEUU), (Thessaloniki, Grecia) 2019 y 2020 (virtual).
- FUNCAS, Jornadas sobre Análisis económico y Big Data, 24 de noviembre de 2020. Co-organizadora con D. Peña y Esther Ruiz.
- FUNCAS, Jornadas sobre Nuevos métodos de predicción en economía con Big Data, 8 de octubre de 2020. Co-organizadora con D. Peña y Esther Ruiz.
- 8 de octubre
- Big data en finanzas, FUNCAS, abril 2019. Co-organizadora, junto con S. Carbó, D. Peña, F. Rodríguez y E. Senra.
- "36th International Symposium on Forecasting" Santander, (España), Junio 2016, Presidente del Comité Científico.
- "1st IIF Workshop on Nonlinearities, Business Cycles and Forecasting", Madrid, (España), 2003. Co-organizadora.
- Encuentro de Economía Aplicada (España), 2016, 2017. Miembro del Comité Científico.
- CFE-ERCIM, Oviedo, (España), 2012. Miembro del Comité Científico.
- Simposio de Análisis Económico (España), 2008, 2009, 2010. Miembro del Comité Científico.
- Jornadas de Docencia en Economía, (Toledo 2013, Bilbao 2014). Miembro del Comité Científico.

DIRECCIÓN DE TESIS DOCTORALES

- 2012 Poncela, M. Univ. de Valladolid (co-dirigido con JR Perán).
- 2014 Sierra, L. Univ. Autónoma de Madrid (co-dirigido con E. Senra).
- 2015 Fuentes, J. Univ. Carlos III de Madrid (co-dirigido con E. Ruiz y J. Rodríguez).
- 2017 Corona, F. Univ. Carlos III de Madrid (co-dirigido con E Ruiz).
- 2017 Cuerpo, C. Universidad Autónoma de Madrid.
- 2019 Bógalo, J., Universidad de Alcalá (co-dirigido con E. Senra).

EXPERIENCIA DOCENTE (UAM)

- Introducción a la Econometría (Licenciatura en Economía)
- Econometría I (Licenciatura en Economía, Grado en Economía).
- Econometría II (Licenciatura en Economía, Grado en Economía).
- Econometría (Máster en Economía Internacional).
- Estrategias Empíricas (Máster en Economía Internacional).

- Series Temporales (Licenciatura en Economía, Curso de Doctorado en Economía, Grado en Economía, Máster en Economía Cuantitativa).
- Econometría II (en inglés, Grado en Economía y Finanzas).
- Econometría Avanzada (Máster en Economía Cuantitativa).
- Economía Empírica (Licenciatura en Economía)
- Modelo Factorial Dinámico (Doctorado en Economía, Universidad de Alcalá).

OTROS

- 3 sexenios de investigación reconocidos: 1998-2003, 2004-2009, 2010-2015.
- 5 quinquenios de docencia reconocidos, último año concedido 2018.
- Consultoría: Lease Plan, Crédito y Caución, BBVA.