



Ministerio de Economía y Competitividad
Secretaría de Estado de Investigación,
Desarrollo e Innovación

Curriculum vitae

Nombre: María Concepción Ausín Olivera

Fecha: 27 de octubre de 2023

Apellidos: Ausín Olivera
DNI: 05653537E

Nombre: María Concepción
Fecha de nacimiento : 16 de noviembre de 1974 Sexo: Mujer

Situación profesional actual

Organismo: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad, Escuela o Instituto: Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas
Depto./Secc./Unidad estr.: Departamento de Estadística
Dirección postal: Calle Madrid, 126, 28903 Getafe, Madrid, España.

Teléfono (indicar prefijo, número y extensión): 91 624 58 52
Fax: 91 624 98 49
Correo electrónico: concepcion.ausin@uc3m.es

Especialización (Códigos UNESCO):

Categoría profesional: Profesor Titular

Fecha de inicio: 01/04/2011

Situación administrativa

Plantilla

Contratado

Interino

Becario

Otras situaciones especificar:

Dedicación

A tiempo completo

A tiempo parcial

Líneas de investigación

Breve descripción, por medio de palabras claves, de la especialización y líneas de investigación actuales.

Estimación Bayesiana: paramétrica y no paramétrica, cópulas, riesgo medioambiental, cambio climático, series temporales financieras, modelos GARCH multivariantes, Valor en Riesgo, riesgo de seguros, selección óptima de carteras, sistemas de colas, datos circulares, análisis de microarrays.

Formación Académica

Titulación Superior	Centro	Fecha
Licenciada en CC. Matemáticas	Universidad Complutense de Madrid	Junio 1997

Doctorado	Centro	Fecha
Ingeniería Matemática: Ciencias y Técnicas Estadísticas.	Departamento de Estadística. Universidad Carlos III de Madrid.	19 de Febrero 2004

Actividades anteriores de carácter científico profesional

Puesto	Institución	Fechas
Profesora Visitante	Departamento de Estadística. Universidad Carlos III de Madrid	01/09/2009-31/04/2011
Ayudante Doctor	Departamento de Estadística e Investigación Operativa. Universidad Complutense de Madrid	13/11/2007-31/08/2009
Investigadora del Programa Isidro Parga Pondal de la Xunta de Galicia.	Departamento de Matemáticas. Universidade da Coruña	06/10/2005-12/11/2007
Ayudante (LOU)	Departamento de Estadística. Universidad Carlos III de Madrid	01/10/2003-30/09/2005
Ayudante de Escuela Universitaria	Departamento de Estadística. Universidad Carlos III de Madrid	01/10/1998-30/09/2003

Idiomas (R = regular, B = bien, C = correctamente)

Idioma	Habla	Lee	Escribe
Inglés	B	C	C
Francés	R	B	R

Participación en Proyectos de I+D financiados en Convocatorias públicas. (nacionales y/o internacionales)

Título del proyecto: Modelización de dependencias en altas dimensiones

Entidad financiadora: Ministerio de Ciencia e Innovación

Duración, desde: 2023 hasta: 2025

Investigador responsable: María Concepción Ausín y Michael Peter Wiper

Título del proyecto: Procedimientos estadísticos computacionales para datos dinámicos con estructura de dependencia compleja y aplicaciones

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración, desde: 2020 hasta: 2023

Investigador responsable: Pedro Galeano San Miguel y Andrés Alonso

Título del proyecto: Big Data y datos complejos en Empresa y Finanzas

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración, desde: 2016 hasta: 2019

Investigador responsable: Daniel Peña Sánchez de Rivera y Juan Romo Urroz

Título del proyecto: Potenciación de la divulgación científica de la UCC+I de la UC3M

Entidad financiadora: Ministerio de Economía y Competitividad

Duración, desde: 2013 hasta: 2014

Investigador responsable: María Luz Neira Jiménez

Título del proyecto: Análisis de datos de muy alta dimensión en Economía y Empresa

Entidad financiadora: Ministerio de Educación y Ciencia

Duración, desde: 2012 hasta: 2014

Investigador responsable: Juan Romo Urroz

Título del proyecto: Procedimientos estadísticos basados en datos funcionales y datos en alta dimensión con aplicaciones en finanzas y bioestadística.

Entidad financiadora: Comunidad de Madrid.

Duración, desde: 2011 hasta: 2011

Investigador responsable: Rosa Lillo Rodríguez

Título del proyecto: Inferencia estadística no paramétrica: Aplicaciones en análisis térmico, riesgo de crédito, malherbología y genómica.

Entidad financiadora: Ministerio de Ciencia e Innovación.

Duración, desde: 2009 hasta: 2011

Investigador responsable: Ricardo Cao Abad

Título del proyecto: Modelización estadística do risco en finanzas e seguros. Desenvolvemento de ferramentas infomáticas.

Entidad financiadora: Consellería de Innovación e Industria, Xunta de Galicia.

Duración, desde: 2007 hasta: 2010

Investigador responsable: Juan Vilar Fernández

Título del proyecto: Consolidación del grupo de investigación Métodos Bayesianos

Entidad financiadora: Banco Santander Central Hispano – Universidad Complutense de Madrid.

Duración, desde: 2009 hasta: 2010

Investigador responsable: Miguel Ángel Gómez Villegas

Título del proyecto: Modelización, contrastes e inferencia no paramétrica: análisis de supervivencia, datos dependientes y aplicaciones (Incorporación en 2008).

Entidad financiadora: Ministerio de Educación

Duración, desde: 2005 hasta: 2008

Investigador responsable: Ricardo Cao Abad

Título del proyecto: Consolidación e estruturación del grupo MODES como unidad de investigación competitiva do SUG.

Entidad financiadora: Consellería de Educación e Ordenación Universitaria, Xunta de Galicia.

Duración, desde: 2007 hasta: 2007

Investigador responsable: Ricardo Cao Abad

Título del proyecto: Selección de modelos estadísticos para bancos de datos empresariales de alta dimensión.

Entidad financiadora: Ministerio de Educación y Ciencia

Duración, desde: 2004 hasta: 2007

Investigador responsable: Daniel Peña Sánchez de Rivera

Título del proyecto: Modelización Estadística y Análisis de Datos

Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.

Duración, desde: 2006 hasta: 2007

Investigador responsable: Daniel Peña Sánchez de Rivera

Título del proyecto: Técnicas no paramétricas y de computación intensiva en Estadística

Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.

Duración, desde: 2006 hasta: 2006

Investigador responsable: Juan José Romo Urroz

Título del proyecto: Técnicas no paramétricas para datos económicos.

Entidad financiadora: Comunidad Autónoma de Madrid.

Duración, desde: 2005 hasta: 2005

Investigador responsable: Juan José Romo Urroz

Título del proyecto: Análisis estadístico de grandes bancos de datos económicos y empresariales con estructura compleja.

Entidad financiadora: Ministerio de Ciencia y Tecnología.

Duración, desde: 2000 hasta: 2003

Investigador responsable: Daniel Peña Sánchez de Rivera

Publicaciones o Documentos Científico-Técnicos

(CLAVE: L = libro completo, CL = capítulo de libro, A = artículo, R = "review", E = editor,
S = Documento Científico-Técnico restringido.)

ARTÍCULOS EN JCR

Autores (p.o. de firma): Hoang Nguyen, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: Variational inference for high dimensional structured factor copulas.
Ref. X revista: Computational Statistics and Data Analysis Libro
Clave: A Volumen: 151, 107012 Páginas, inicial: final: Fecha: 2020
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Audrone Virbickaite, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: Copula Stochastic Volatility in oil returns: Approximate Bayesian Computation with volatility prediction.
Ref. X revista: Energy Economics Libro
Clave: A Volumen: 92, 104961 Páginas, inicial: final: Fecha: 2020
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Hoang Nguyen, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: Parallel Bayesian inference for high dimensional dynamic factor copulas.
Ref. X revista: Journal of Financial Econometrics Libro
Clave: A Volumen: 17 Páginas, inicial: 118 final: 151 Fecha: 2019
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Audrone Virbickaite, Hedibert F. Lopes, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: Particle Learning for Bayesian Semi-Parametric Stochastic Volatility Model.
Ref. X revista: Econometric Reviews Libro
Clave: A Volumen: 38 Páginas, inicial: 1007 final: 1023 Fecha: 2019
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Ali Sarhadi, M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper, D. Touma and N.S. Diffenbaugh
Título: Multi-dimensional risk in a non-stationary climate: joint probability of increasingly severe warm and dry conditions.
Ref. X revista: Science Advances Libro
Clave: A Volumen: 4 Páginas, inicial: Article number: no. 11. Fecha: 2018
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Mario Gómez, M. Concepción Ausín, M. Carmen Domínguez
Título: Vine copula models for predicting water flow discharge at King George Island, Antarctica
Ref. X revista: Stochastic Environmental Research and Risk Assessment Libro

Clave: A Volumen: 32 Páginas, inicial: 2787 final: 2807 Fecha: 2018
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): José A. Carnicero, M. Concepción Ausín, Michel P. Wiper
Título: Density estimation of circular data with Bernstein polynomials

Ref. X revista: Hacettepe Journal of Mathematics and Statistics Libro
Clave: A Volumen: 47 Páginas, inicial: 273 final: 286 Fecha: 2018
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Mario Gómez, M. Concepción Ausín, M. Carmen Domínguez
Título: Seasonal copula models for the analysis of glacier discharge at King George Island, Antarctica.

Ref. X revista: Stochastic Environmental Research and Risk Assessment Libro
Clave: A Volumen: 31 Páginas, inicial: 1107 final: 1121 Fecha: 2017
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Ali Sarhadi, M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper
Título: A New Time-varying Concept of Risk in a Changing Climate.

Ref. X revista: Nature Scientific Reports Libro
Clave: A Volumen: 6 Páginas, inicial: Article number: 35755. final: Fecha: 2016
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Ali Sarhadi, Donald H. Burn, M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper
Título: Time-varying nonstationary multivariate risk analysis using a dynamic Bayesian copula.

Ref. X revista: Water Resources Research Libro
Clave: A Volumen: 52 Páginas, inicial: 2327 final: 2349 Fecha: 2016
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Audrone Virbickaitė, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: A Bayesian Non-Parametric Approach to Asymmetric Dynamic Conditional Correlation Model with Application to Portfolio Selection

Ref. X revista: Computational Statistics and Data Analysis Libro
Clave: A Volumen: 100 Páginas, inicial: 814 final: 829 Fecha: 2016
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Gabriel Núñez-Antonio, M. Concepción Ausín, Michel P. Wiper
Título: Bayesian nonparametric models of circular variables based on Dirichlet process mixtures of normal distributions

Ref. X revista: Journal of Agricultural, Biological, and Environmental Statistics
Libro
Clave: A Volumen: 20 Páginas, inicial: 47 final: 64 Fecha: 2015

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Audrone Virbickaite, M. Concepción Ausín, Pedro Galeano
Título: Bayesian inference methods for univariate and multivariate GARCH models: a survey

Ref. revista: Journal of Economic Surveys Libro
Clave: A Volumen: 29 Páginas, inicial: 76 final: 96 Fecha: 2015
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Pedro Galeano, Pulak Ghosh
Título: A semiparametric Bayesian approach to the analysis of financial time series with applications to Value at Risk estimation

Ref. revista: European Journal of Operational Research Libro
Clave: A Volumen: 232 Páginas, inicial: 350 final: 358 Fecha: 2014
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): José A. Carnicero, M. Concepción Ausín, Michel P. Wiper
Título: Non-parametric copulas for circular-linear and circular-circular data: an application to wind directions

Ref. revista: Stochastic Environmental Research and Risk Assessment Libro
Clave: A Volumen: 27 Páginas, inicial: 1991 final: 2002 Fecha: 2013
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Juan M. Vilar, Ricardo Cao y Cristina González-Fragueiro
Título: Bayesian analysis of aggregate loss models

Ref. revista: Mathematical Finance Libro
Clave: A Volumen: 21 Páginas, inicial: 257 final: 279 Fecha: 2011
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. C. Ausín, M. A. Gómez-Villegas, B. González-Pérez, M. T. Rodríguez Bernal, L. Sanz.
Título: Bayesian analysis of multiple hypothesis testing with applications to microarray experiments

Ref. revista: Communications in Statistics – Theory and Methods Libro
Clave: A Volumen: 40 Páginas, inicial: 2276 final: 2291 Fecha: 2011
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): Pedro Galeano y M. Concepción Ausín
Título: The Gaussian Mixture Dynamic Conditional Correlation Model: Parameter Estimation, Value at Risk calculation and portfolio selection

Ref. revista: Journal of Business and Economic Statistics Libro
Clave: A Volumen: 28 Páginas, inicial: 559 final: 571 Fecha: 2010
Editorial (si libro):

Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín y Hedibert Lopes
Título: Time-varying joint distribution through copulas

Ref. X revista: Computational Statistics and Data Analysis Libro
Clave: A Volumen: 54 Páginas, inicial: 2383 final: 2399 Fecha: 2010

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper y Rosa E. Lillo.
Título: Bayesian estimation of finite time ruin probabilities

Ref. X revista: Applied Stochastic Models in Business and Industry Libro
Clave: A Volumen: 25 Páginas, inicial: 787 final: 805 Fecha: 2009

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): J.M. Vilar, R. Cao, M. Concepción Ausín y C. González-Fragueiro
Título: Nonparametric analysis of aggregate loss models

Ref. X revista: Journal of Applied Statistics Libro
Clave: A Volumen: 36 Páginas, inicial: 149 final: 166 Fecha: 2009

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper y Rosa E. Lillo.
Título: Bayesian prediction of the transient behaviour and busy period in short- and long-tailed GI/G/1 queueing systems

Ref. X revista: Computational Statistics and Data Analysis Libro
Clave: A Volumen: 52 Páginas, inicial: 1615 final: 1635 Fecha: 2008

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín y Hedibert Lopes
Título: Bayesian estimation of ruin probabilities with heterogeneous and heavy-tailed insurance claim size distribution

Ref. X revista: Australian and New Zealand Journal of Statistics Libro
Clave: A Volumen: 49 Páginas, inicial: 1 final: 20 Fecha: 2007

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Bayesian control of the number of servers in a GI/M/c queueing system

Ref. X revista: Journal of Statistical Planning and Inference Libro
Clave: A Volumen: 137 Páginas, inicial: 3043 final: 3057 Fecha: 2007

Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín y Pedro Galeano
Título: Bayesian estimation of the Gaussian mixture GARCH model

Ref. revista: Computational Statistics and Data Analysis Libro
Clave: A Volumen: 51 Páginas, inicial: 2636 final: 2652 Fecha: 2007
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper y Rosa E. Lillo
Título: Bayesian estimation for the M/G/1 queue using a phase type approximation

Ref. revista: Journal of Statistical Planning and Inference Libro
Clave: A Volumen: 118 Páginas, inicial: 83 final: 101 Fecha: 2004
Editorial (si libro):
Lugar de publicación:

OTROS ARTÍCULOS

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín
Título: Markov Chain Monte Carlo, Introduction

Ref. revista: Libro: Wiley StatsRef: Statistics Reference Online. 1-10 Update based on original article by Michael Wiper, Wiley StatsRef: Statistics Reference Online, © 2014, John Wiley & Sons, Ltd.
Clave: CL Volumen: II Páginas, inicial: final: Fecha: 2015
Editorial (si libro): Risk Books
Lugar de publicación: London, England

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín and Hedibert Lopes
Título: Bayesian prediction of risk measurements using copulas

Ref. revista: Libro: Rethinking Risk Measurement and Reporting
Clave: CL Volumen: II Páginas, inicial: final: Fecha: 2010
Editorial (si libro): Risk Books
Lugar de publicación: London, England

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín
Título: Queues in Reliability

Ref. revista: Libro: Encyclopedia of Statistics in Quality and Reliability
Clave: CL Volumen: Páginas, inicial: 1550 final: 1554 Fecha: 2007
Editorial (si libro): Wiley
Lugar de publicación: Chichester, England

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín
Título: An introduction to quadrature and other numerical integration techniques

Ref. revista: Libro: Encyclopedia of Statistics in Quality and Reliability
Clave: CL Volumen: Páginas, inicial: 1521 final: 1526 Fecha: 2007
Editorial (si libro): Wiley

Lugar de publicación: Chichester, England

Autores (p.o. de firma): M. Concepción Ausín, Rosa. E. Lillo, Michael P. Wiper y Fabrizio Ruggeri
Título: Modeling of Hospital Bed Occupancy Times using a Mixed Generalized Erlang Distribution

Ref. revista:

X Libro: Bayesian Statistics 7

Clave: CL

Páginas, inicial: 443 final: 451

Fecha: 2003

Editorial (si libro): Oxford University Press

Lugar de publicación: Oxford, England

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Participación en contratos de I+D de especial relevancia con Empresas y/o Administraciones
(nacionales y/o internacionales)

Título del contrato/proyecto: Predicción del número óptimo de vendedores en tiendas Telyco

Tipo de contrato: No Competitivo, Artículo 83

Empresa/Administración financiadora: Teleinformática y Comunicaciones, S.A.

Entidades participantes: TELYCO, UC3M

Duración, desde: 01/05/2012 hasta: 25/06/2012

Investigador responsable: Rosa Lillo y Nora Lado

Número de investigadores participantes: 4

PRECIO TOTAL DEL PROYECTO: 30.000€

Título del contrato/proyecto:

Tipo de contrato:

Empresa/Administración financiadora:

Entidades participantes:

Duración, desde: hasta:

Investigador responsable:

Número de investigadores participantes:

PRECIO TOTAL DEL PROYECTO: XXXXXXXXXX

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Patentes y Modelos de utilidad

Inventores (p.o. de firma):

Título:

N. de solicitud:

País de prioridad:

Fecha de prioridad:

Entidad titular:

Países a los que se ha extendido:

Empresa/s que la están explotando:

Inventores (p.o. de firma):

Título:

N. de solicitud:

País de prioridad:

Fecha de prioridad:

Entidad titular:

Países a los que se ha extendido:

Empresa/s que la están explotando:

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Estancias en Centros extranjeros
(estancias continuadas superiores a un mes)

CLAVE: D = doctorado, P = postdoctoral, I = invitado, C = contratado, O = otras (especificar).

Centro: Graduate School of Business. University of Chicago.
Localidad: Chicago País: Estados Unidos Fecha: Agosto 2005 Duración (semanas): 4
Tema: Análisis de series GARCH multivariantes mediante cópulas
Clave: P

Centro: Graduate School of Business. University of Chicago.
Localidad: Chicago País: Estados Unidos Fecha: Sep. 2004/ Feb. 2005 Duración (semanas): 24
Tema: Análisis de riesgo en compañías de seguros
Clave: P

Centro: C. N. R. -IAMI. Istituto per le Applicazioni della Matematica e dell'Informatica
Localidad: Milán País: Italia Fecha: 2001 Duración (semanas): 4
Tema: Modelos Bayesianos para el análisis de la ocupación de camas en hospitales
Clave: D

Centro: Universidad Nacional San Antonio Abad del Cusco
Localidad: Cuzco País: Perú Fecha: 2000 Duración (semanas): 4
Tema: Módulo "Diseño de Experimentos" de la Maestría de Estadística Aplicada
Clave: I

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Contribuciones a Congresos

Autores: M. Concepción Ausín, Maria Kalli
Título: Bayesian nonparametric copulas with tail dependence

Tipo de participación: poster
Congreso: European Seminar on Bayesian Econometrics 2022
Publicación:

Lugar celebración: Salzburgo Fecha: Septiembre, 2022.

Autores: M. Concepción Ausín, Maria Kalli
Título: Bayesian nonparametric copulas with tail dependence

Tipo de participación: oral
Congreso: XXXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa
Publicación:

Lugar celebración: Granada Fecha: Junio, 2022.

Autores: M. Concepción Ausín
Título: Discussion on the paper "Approximate Bayesian Conditional Copulas" by Clara Grazian.

Tipo de participación: oral
Congreso: Bayesian Inference in Stochastic Processes (BISP 2021)
Publicación:

Lugar celebración: Online Fecha: Mayo, 2021.

Autores: M. Concepción Ausín, A. Virbickaite y P. Galeano
Título: Copula Stochastic Volatility in spot oil returns: Approximate Bayesian Computation with VaR application

Tipo de participación: oral
Congreso: 13th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2019)
Publicación:

Lugar celebración: Londres. Fecha: Diciembre, 2019.

Autores: M. Concepción Ausín, A. Virbickaite y P. Galeano
Título: Copula Stochastic Volatility in spot oil returns: Approximate Bayesian Computation with VaR application

Tipo de participación: oral
Congreso: European Seminar on Bayesian Econometrics 2019

Publicación:

Lugar celebración: Saint Andrews, Escocia. Fecha: Septiembre, 2019.

Autores: M. Concepción Ausín, M. Gómez y C. Domínguez
Título: Bayesian hierarchical vine copula models for the analysis of glacier discharge.

Tipo de participación: oral
Congreso: 11th International Conference of the ERCIM Working Group on Computational and Methodological Statistics

Publicación:

Lugar celebración: Pisa
Fecha: Diciembre, 2018.

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y H. Nguyen
Título: Variational Inference for high dimensional structured factor copulas.

Tipo de participación: poster
Congreso: ISBA World Meeting

Publicación:

Lugar celebración: Edimburgo
Fecha: Junio, 2018.

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y H. Nguyen
Título: Variational Inference for high dimensional factor copulas.

Tipo de participación: oral
Congreso: Workshop Métodos Bayesianos 2017

Publicación:

Lugar celebración: Madrid.
Fecha: Noviembre, 2017

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y Simon Wilson
Título: Approximate Bayesian Computation for phase-type distributions.

Tipo de participación: oral
Congreso: 8th International Conference of the ERCIM Working Group on Computational and Methodological Statistics

Publicación:

Lugar celebración: Sevilla.
Fecha: Diciembre, 2016.

Autores: M. Concepción Ausín, M. Gómez y C. Domínguez
Título: Copula-based models for the analysis of glacier discharge at King George Island, Antarctica

Tipo de participación: oral
Congreso: XXXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa
Publicación:

Lugar celebración: Pamplona.
Fecha: Mayo, 2015

Autores: M. Concepción Ausín, M. Gómez y C. Domínguez
Título: Copula-based models for the analysis of glacier discharge at King George Island, Antarctica

Tipo de participación: oral
Congreso: 7th International Conference of the ERCIM Working Group on Computational and Methodological Statistics
Publicación:

Lugar celebración: Pisa, Italia.

Fecha: Diciembre, 2014

Autores: M. Concepción Ausín, A. Virbickaite, P. Galeano y H.F. Lopes.
Título: Particle Learning for Bayesian Non-Parametric Stochastic Volatility Models

Tipo de participación: oral
Congreso: Second Conference of the International Society for Non-Parametric Statistics
Publicación:

Lugar celebración: Cádiz

Fecha: Junio, 2014

Autores: M. Concepción Ausín, A. Virbickaite y P. Galeano
Título: A Bayesian Non-Parametric Approach to Asymmetric Dynamic Conditional Correlation Model with Application to Portfolio Selection

Tipo de participación: póster
Congreso: XXIX-th European Meeting of Statisticians
Publicación:

Lugar celebración: Budapest

Fecha: Julio, 2013

Autores: M. Concepción Ausín
Título: Bayesian nonparametric copulas for multivariate time series

Tipo de participación: oral
Congreso: 6th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics
Publicación:

Lugar celebración: Oviedo

Fecha: Diciembre, 2012

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y Pulak Ghosh
Título: A Semiparametric Bayesian Approach to the GARCH Model with Application to Value at Risk Estimation

Tipo de participación: oral
Congreso: Yeditepe International Research Conference on Bayesian Learning
Publicación:

Lugar celebración: Estambul

Fecha: Junio, 2011

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y Pulak Ghosh
Título: A semiparametric Bayesian approach to the analysis of volatilities and Value at Risk in financial time series

Tipo de participación: oral
Congreso: 4th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics
Publicación:

Lugar celebración: Londres

Fecha: Diciembre, 2010

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y Pulak Ghosh
Título: Bayesian nonparametric analysis of GARCH models

Tipo de participación: oral
Congreso: XXXII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa
Publicación:

Lugar celebración: A Coruña Fecha: Septiembre, 2010

Autores: M. Concepción Ausín, Pedro Galeano y Pulak Ghosh
Título: Bayesian nonparametric analysis of GARCH models

Tipo de participación: póster
Congreso: 19th International Conference on Computational Statistics
Publicación:

Lugar celebración: Paris Fecha: Agosto, 2010

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Bayesian estimation of finite time ruin probabilities

Tipo de participación: oral
Congreso: 3rd International Workshop on Computational and Financial Econometrics
Publicación:

Lugar celebración: Limassol, Chipre Fecha: Octubre, 2009

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Bayesian estimation of finite time ruin probabilities

Tipo de participación: oral
Congreso: XXXI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa
Publicación:

Lugar celebración: Murcia Fecha: Febrero, 2009

Autores: M. Concepción Ausín, Juan M. Vilar, Ricardo Cao, Cristina González-Fragueiro
Título: Bayesian analysis of aggregate loss models

Tipo de participación: oral
Congreso: 6th World Conference of the International Assotiation for Statistical Computing
Publicación:

Lugar celebración: Yokohama, Japón Fecha: Diciembre, 2008

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano.
Título: The Gaussian Mixture Dynamic Conditional Correlation Model: Bayesian Estimation, Value at Risk calculation and portfolio selection

Tipo de participación: oral

Congreso: 2nd International Workshop on Computational and Financial Econometrics
Publicación:

Lugar celebración: Neuchâtel, Suiza

Fecha: Junio, 2008

Autores: M. Concepción Ausín y Hedibert Lopes

Título: Bayesian estimation of ruin probabilities with a heterogeneous and heavy-tailed insurance claim size distribution

Tipo de participación: oral

Congreso: XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Valladolid

Fecha: Septiembre, 2007

Autores: M. Concepción Ausín, Juan M. Vilar, Ricardo Cao, Cristina González-Fragueiro

Título: Bayesian analysis of aggregate loss models

Tipo de participación: póster

Congreso: 56th Session of the International Statistical Institute

Publicación: ISI 2007 Book of Abstracts

Lugar celebración: Lisboa

Fecha: Agosto, 2007

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano

Título: A Bayesian approach to Value at Risk estimation via multivariate GARCH models with Gaussian mixture innovations

Tipo de participación: póster

Congreso: 56th Session of the International Statistical Institute

Publicación: ISI 2007 Book of Abstracts

Lugar celebración: Lisboa

Fecha: Agosto, 2007

Autores: M. Concepción Ausín, Michael P. Wiper y Rosa E. Lillo

Título: Bayesian estimation of finite time ruin probabilities

Tipo de participación: póster

Congreso: Fifth Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes

Publicación:

Lugar celebración: Valencia

Fecha: Junio, 2007

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano

Título: Multivariate GARCH models with Gaussian mixture innovations

Tipo de participación: póster

Congreso: Fifth Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes

Publicación:

Lugar celebración: Valencia

Fecha: Junio, 2007

Autores: M. Concepción Ausín y Hedibert Lopes

Título: Time-varying joint distribution through copulas

Tipo de participación: póster

Congreso: Eight Valencia International Meeting on Bayesian Statistics

Publicación:

Lugar celebración: Benidorm

Fecha: Junio, 2006

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano

Título: Bayesian estimation of the Gaussian mixture GARCH model

Tipo de participación: póster

Congreso: Eight Valencia International Meeting on Bayesian Statistics

Publicación:

Lugar celebración: Benidorm

Fecha: Junio, 2006

Autores: M. Concepción Ausín y Hedibert Lopes

Título: Time-varying joint distribution through copulas

Tipo de participación: oral

Congreso: XXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Tenerife

Fecha: Mayo, 2006

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano

Título: Bayesian estimation of the Gaussian mixture GARCH model

Tipo de participación: póster

Congreso: XXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXIX Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Tenerife

Fecha: Mayo, 2006

Autores: M. Concepción Ausín y Pedro Galeano

Título: Bayesian estimation of the Gaussian mixture GARCH model

Tipo de participación: póster

Congreso: I Congreso de Estatística e Investigación Operacional da Galiza e Norte de Portugal - VII Congreso Galego de Estatística e Investigación de Operacións

Publicación:

Lugar celebración: Guimarães, Portugal

Fecha: Octubre, 2005

Autores: M. Concepción Ausín y Hedibert F.Lopes

Título: Large claims approximation in insurance risk processes

Tipo de participación: póster

Congreso: Fourth Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes

Publicación:

Lugar celebración: Varenna, Italia

Fecha: Mayo, 2005

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper

Título: Bayesian control of the number of servers in a GI/M/c queueing system

Tipo de participación: póster

Congreso: Fourth Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes

Publicación:

Lugar celebración: Varenna, Italia

Fecha: Mayo, 2005

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper

Título: Análisis transitorio y de ocupación en un modelo de colas general

Tipo de participación: oral

Congreso: XXVIII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXVIII Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Cádiz

Fecha: Octubre, 2004

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper

Título: General queueing systems analysis based on the method of stages

Tipo de participación: oral

Congreso: Third Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes

Publicación:

Lugar celebración: La Manga del Mar Menor

Fecha: Mayo, 2003

Autores: M. Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper

Título: Métodos bayesianos en problemas de diseño óptimo en sistemas de colas

Tipo de participación: oral

Congreso: 27 Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del 27 Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Lleida

Fecha: Abril, 2003

Autores: M.Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Estimación bayesiana del sistema de colas G/M/1

Tipo de participación: oral
Congreso: XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXVI Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Lugar celebración: Úbeda
Fecha: 2001

Autores: M.Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Bayesian inference and prediction in M/G/1 queues using a phase type approximation

Tipo de participación: oral
Congreso: Second Workshop on Bayesian inference in Stochastic Processes.

Publicación:
Lugar celebración: Varenna, Italia
Fecha: 2001

Autores: M.Concepción Ausín, Rosa E. Lillo y Michael P. Wiper
Título: Análisis bayesiano de mixturas de distribuciones Erlang con aplicaciones a modelos de colas M/G

Tipo de participación: oral
Congreso: XXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa

Publicación: Actas del XXV Congreso Nacional de Estadística e Investigación Operativa
Lugar celebración: Vigo
Fecha: 2000

Tesis Doctorales dirigidas

Título: Bayesian inference for high dimensional factor copula models

Doctorando: Hoang Nguyen
Universidad: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad / Escuela: Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas
Fecha: 11 de Julio de 2019

Título: Bayesian modeling of glacial discharge in Antarctica using copulas

Doctorando: Mario Gómez Díaz
Universidad: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad / Escuela: Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas
Fecha: 22 de Diciembre de 2017

Título: Contributions to Bayesian non-parametrics

Doctorando: Yanyun Zhao
Universidad: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad / Escuela: Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas
Fecha: 10 de Julio de 2015

Título: Bayesian non-parametrics for time-varying volatility models

Doctorando: Audrone Virbickaite
Universidad: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad / Escuela: Facultad de Ciencias Sociales y Jurídicas
Fecha: 09 de Febrero de 2015

Título: Semiparametric and nonparametric methods for directional data

Doctorando: José Antonio Carnicero Carreño
Universidad: Universidad Carlos III de Madrid
Facultad / Escuela: Escuela Politécnica Superior de Leganés
Fecha: 30 de Junio de 2011

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Participación en comités y representaciones internacionales

Título del Comité:

Entidad de la que depende:

Tema:

Fecha:

Título del Comité:

Entidad de la que depende:

Tema:

Fecha:

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Experiencia en organización de actividades de I+D

Organización de congresos, seminarios, jornadas, etc., científicos-tecnológicos

Título: 11th European Seminar on Bayesian Econometrics
(<http://www.est.uc3m.es/BayesUC3M/ESOB2021/ESOB2021.htm>)

Tipo de actividad: Comité Científico /Comité Organizador Ambito: Internacional

Fecha: 2 – 3 Septiembre, 2021

Título: Workshop in Bayesian Econometrics, Universidad Carlos III de Madrid
(<http://www.est.uc3m.es/BayesUC3M/Workshop/Workshop.html>).

Tipo de actividad: Comité científico Ambito: Internacional

Fecha: 9 – 10 Junio, 2016

Título: Seventh Workshop on Bayesian Inference in Stochastics Processes, Universidad Carlos III de Madrid.

Tipo de actividad: Comité Organizador Ambito: Internacional

Fecha: 1 - 3 Septiembre, 2011

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Experiencia de gestión de I+D
Gestión de programas, planes y acciones de I+D

Título:

Tipo de actividad:
Fecha:

Título:

Tipo de actividad:
Fecha:

Nota: Si necesita más casos, añádalos utilizando las funciones de copiar y pegar con el 2º caso.

Otros méritos o aclaraciones que se desee hacer constar
(utilice únicamente el espacio equivalente a una página).

SEXENIOS:

- 3 sexenios de investigación concedidos (2005-2010; 2011-2016; 2017-2022)

PREMIOS:

- Premio de Excelencia 2015 del Consejo Social de la Universidad Carlos III de Madrid en la modalidad de Joven Personal Investigador. Patrocinadores: Banco Santander, AIRBUS Group y Consejo Social de la UC3M.

SEMINARIOS IMPARTIDOS:

- "Variational inference for high dimensional structured factor copulas", con H. Nguyen and P. Galeano. King's College London. Enero, 2022.
- "Variational inference for high dimensional structured factor copulas", con H. Nguyen and P. Galeano. Queen Mary University London. Mayo, 2021.
- "Copula Stochastic Volatility using Approximate Bayesian Computation methods", con A. Virbickaite y P. Galeano. Departamento de Estructura e Historia Económica y Economía Pública, Universidad de Zaragoza. Octubre, 2019.
- "Parallel Bayesian inference for high dimensional dynamic factor copulas", con H. Nguyen and P. Galeano. Center for Quantitative Economics, University of Münster, Alemania. Julio, 2018.
- "Approximate Bayesian methods for phase-type distributions with applications in insurance risk problems", con P. Galeano y S. Wilson. Department of Economics. Università Ca'Foscari, Venecia. Enero, 2017.
- "Seasonal copula models for the analysis of glacier discharge at King George Island, Antarctica", con M. Gómez y C. Domínguez. Departamento de Estadística e IO. Universidade de Vigo. Noviembre, 2016.
- "ABC methods for phase-type distributions with applications in insurance risk problems", con P. Galeano y S. Wilson. Universidad de las Palmas de Gran Canaria. Septiembre, 2016.
- "Análisis Bayesiano de modelos de riesgo en compañías de seguros". Workshop Bayesiano 08. Universidad Complutense de Madrid. Noviembre, 2008.
- "El modelo de correlación condicional dinámica con mixturas Gaussianas: Inferencia, Valor en Riesgo y selección de carteras", con P. Galeano. Universidad de Zaragoza. Noviembre, 2008.
- "The Gaussian Mixture Dynamic Conditional Correlation Model: Bayesian Estimation, Value at Risk calculation and portfolio selection", con P. Galeano. Universidade de Santiago de Compostela. Julio, 2007.
- "Análisis bayesiano de sistemas de colas con extensiones a riesgos en seguros", con H. F. Lopes, R. E. Lillo y M. P. Wiper. Departamento de Matemáticas. Universidade da Coruña. Diciembre, 2005.
- "Un modelo Bayesiano para la ocupación de camas en hospitales utilizando una distribución MGE", con R. E. Lillo, M. P. Wiper y F. Ruggeri. Universidad Rey Juan Carlos. Abril, 2002.
- "Bayesian Inference in G/M/1 Queueing Systems using the birth-death MCMC method", con M. P. Wiper y R. E. Lillo. C.N.R.-IAMI. Istituto per le Applicazioni della Matematica e dell'Informatica. Milán. Diciembre, 2001.

CURSOS DE FORMACIÓN DOCENTE:

- Plano de Formación Inicial da Universidade da Coruña. Programas de Metodoloxía Didáctica, Contexto Socio- institucional da UDC e Tecnoloxía Educativa. A Coruña. 2007. Duración: 108 horas.
- Plano de Formación Inicial da Universidade da Coruña. Programa de Saúde e Prevención de Riscos Laborais. A Coruña. 2006. Duración: 48 horas.
- "Jornadas de Orientación y Mejora Docente". Universidad Carlos III, Getafe, Madrid. 2005. Duración: 10 horas.