

CURRÍCULUM VITAE

Datos Personales:

Nombre: José Alberto
Apellidos: Mauricio Arias
Lugar y fecha de nacimiento: Madrid, 22 de abril de 1965

Teléfono: 913942597
Correo electrónico: jamauri@ccee.ucm.es
Internet: ucm.randomshock.com

Categoría profesional actual: Profesor Titular de Universidad (desde el 23-08-1995)
Tramos docentes (quinquenios): Siete (hasta el 23-08-2024)
Tramos de investigación (sexenios): Dos (hasta el 31-12-2007)

Formación Académica:

[1988] Licenciatura: Licenciado en Ciencias Económicas y Empresariales (Rama de Economía General, Especialidad en Análisis Económico y Economía Cuantitativa) - Universidad Complutense de Madrid.

[1993] Doctorado: Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales - Apto Cum Laude por Unanimidad - Universidad Complutense de Madrid.

Tesis Doctoral: "Evaluación y Maximización de la Función de Verosimilitud de Procesos ARMA Multivariantes". Leída el 15-01-1993.

Director de la Tesis: Dr. D. Arthur B. Treadway.

[1995] Premio Extraordinario de Doctorado de Economía General del curso 1992-93. Concedido el 12-05-1995 - Universidad Complutense de Madrid.

Situación Profesional Actual:

Organismo: Universidad Complutense de Madrid
Facultad: Ciencias Económicas y Empresariales
Departamento: Análisis Económico y Economía Cuantitativa
Categoría Profesional: Profesor Titular de Universidad a Tiempo Completo
Fecha de Inicio: 23-08-1995
Dirección Postal: Campus de Somosaguas. 28223 Pozuelo de Alarcón (Madrid)

Experiencia Docente en Licenciatura y Grado - Universidad Complutense de Madrid:

Profesor Ayudante de Escuela Universitaria (18-11-1988 a 30-1-1990, y 6-11-1990 a 23-8-1994):

- Profesor de Econometría Empresarial (1988/89).
- Profesor de prácticas de Métodos Econométricos I y II (1989/90).
- Profesor de prácticas de Teoría de la Optimización (1990/91).
- Profesor de Teoría de la Optimización (1991/92 a 1993/94).

Profesor Titular de Universidad Interino (28-10-94 a 13-12-1994) y Profesor Titular de Escuela Universitaria (14-12-94 a 22-8-95):

- Profesor de Teoría de la Optimización (1994/95).

Profesor Titular de Universidad (desde el 23-8-1995):

- Profesor de Teoría de la Optimización (1995/96 a 1997/98).
- Profesor de Econometría I (1997/98 a 2011/12).
- Profesor de Econometría II (1998/99, 1999/00, 2001/02 a 2007/08 y 2009/10 a 2011/12).
- Coordinador de las asignaturas Econometría I y II (2000/01 a 2002/03 y 2006/07 a 2009/10).
- Profesor de Series Temporales (2003/04 a 2005/06).
- Profesor de Econometría Superior (2008/09 a 2009/10).
- Profesor de Econometría (Grado adaptado al EEES) (2011/12 a 2024/25).
- Profesor de Econometría Aplicada (Grado adaptado al EEES) (2012/13 a 2024/25).
- Tutor de 10 Trabajos de Fin de Grado (2013/14 a 2014/15).

Experiencia Docente en Posgrado:

Profesor de Estadística (1996/97 a 2000/01) y Econometría (2000/01) en el Doctorado en Análisis Económico de la Universidad Complutense de Madrid.

Profesor de Econometría Superior (1997/98) en el Doctorado en Economía y Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Europea de Madrid (CEES).

Profesor de Análisis Matemático (1997/98 y 1998/99) en el Master en Economía Aplicada: La Economía de la Unión Europea del Instituto Universitario Ortega y Gasset.

Director y profesor del curso "Econometría: Fundamentos, Métodos y Aplicaciones" de la Escuela Complutense de Verano 2002.

Profesor de Econometría (1999/00 a 2006/07) en el Master en Análisis Económico y Economía Financiera de la Universidad Complutense de Madrid.

Otra Actividad Profesional:

- Consultor en Decision Support Systems (DSS), S.A. (5-2-1990 hasta 4-8-1990).

Participación en Proyectos de Investigación Financiados:

- Ayudante de investigación en el proyecto "Experimentos en la Econometría de Series Temporales Referidos a la Economía Española," dirigido por el Dr. Arthur B. Treadway – PB89-0129 – Ministerio de Educación y Ciencia, 1991-1992.

- Ayudante y adjunto de investigación en el proyecto "Un Servicio de Previsión y Seguimiento de la Economía Española (SPS:EE)," dirigido por el Dr. Arthur B. Treadway – Patrocinado por Caja de Madrid, 1990-1996.
- Investigador en el proyecto "Experimentos en la Econometría de Series Temporales Referidos a la Economía Española," dirigido por el Dr. Arthur B. Treadway – PB95-0906 – Ministerio de Educación, Cultura y Deporte, 1997-1999.
- Investigador en el proyecto "Experimentos en la Econometría de Series Temporales Referidos a la Economía Española," dirigido por el Dr. Arthur B. Treadway – PB98-0847 – Ministerio de Educación, Cultura y Deporte, 2000-2002.
- Responsable del proyecto de innovación educativa "Implantación de una Plataforma de Gestión de Aprendizaje." – PIE 2003/23 – Universidad Complutense de Madrid, curso académico 2003/04.
- Investigador en el proyecto "Técnicas de Subespacios: Aplicaciones a la Modelización y Desagregación de Series Temporales Económicas," dirigido por la Dra. Sonia Sotoca López – SEJ2005-07388/ECON – Ministerio de Educación y Ciencia, 2005-2008.
- Miembro del grupo "Econometría en Espacio de los Estados," dirigido por el Dr. Miguel Jerez Méndez – GR35/10-B-940223 – Programa de Grupos de Investigación Validados Santander-UCM – Universidad Complutense - Comunidad de Madrid, 2006-2021.
- Participante en el proyecto de innovación educativa "Sistemas de Evaluación Objetiva a Distancia." – PIE 2010/56 – Universidad Complutense de Madrid, curso académico 2010/11.
- Investigador en el proyecto "Aplicación de los Métodos de Subespacios: Análisis Masivo de Series Históricas y Datos Financieros," dirigido por el Dr. Miguel Jerez Méndez – ECO2008-02588/ECON – Ministerio de Ciencia e Innovación, 2009-2012.

Trabajos Científicos Publicados:

- [1992] "Evaluación y Maximización de la Función de Verosimilitud de Procesos ARMA Multivariantes," Tesis Doctoral dirigida por el Dr. Arthur B. Treadway. Publicada en 2002 por el Servicio de Publicaciones de la UCM, ISBN (13): 978-84-669-0137-6.
- [1995] "Exact Maximum Likelihood Estimation of Stationary Vector ARMA Models," *Journal of the American Statistical Association*, Vol. 90, No. 429, pp. 282-291.
- [1995] "A Corrected Algorithm for Computing the Theoretical Autocovariance Matrices of a Vector ARMA Model," *Instituto Complutense de Análisis Económico*, Documento 9502.
- [1996] "Some Computational Aspects of Exact Maximum Likelihood Estimation of Time Series Models," en *COMPSTAT 1996 Proceedings on Computational Statistics*, Ed. A. Prat, Heidelberg: Physica-Verlag, pp. 361-366.
- [1997] "Algorithm AS 311: The Exact Likelihood Function of a Vector Autoregressive Moving Average Model," *Journal of the Royal Statistical Society - Series C (Applied Statistics)*, Vol. 46, No. 1, pp. 157-171.
- [2002] "An Algorithm for the Exact Likelihood of a Stationary Vector Autoregressive-Moving Average Model," *Journal of Time Series Analysis*, Vol. 23, No. 4, pp. 473-486.

- [2006] "Exact Maximum Likelihood Estimation of Partially Nonstationary Vector ARMA Models," *Computational Statistics and Data Analysis*, Vol. 50, No. 12, pp. 3644-3662.
- [2006] "Residuals in Time Series Models," en *COMPSTAT 2006 Proceedings on Computational Statistics*, Eds. A. Rizzi, M. Vichi, Heidelberg: Physica-Verlag, pp. 1179-1186.
- [2007] "Introducción al Análisis de Series Temporales," *CERSA*, ISBN (13): 978-84-96854-01-7.
- [2008] "Computing and Using Residuals in Time Series Models," *Computational Statistics and Data Analysis*, Vol. 52, No. 3, pp. 1746-1763.

Ponencias Presentadas a Congresos:

Título: Exact Maximum Likelihood Estimation of Stationary Vector ARMA Models.

Congreso: XVIII Simposio de Análisis Económico.

Entidad organizadora: Departamento de Economía e Historia Económica e Instituto de Análisis Económico (CSIC) de la Universidad Autónoma de Barcelona.

Lugar de celebración: Universidad Autónoma de Barcelona.

Fecha: del 15 al 17-12-1993.

Título: The Design and Use of Software for Estimation of Time Series Models.

Congreso: The 16th Annual International Symposium on Forecasting (ISF '96).

Entidad organizadora: International Institute of Forecasters (IIF).

Lugar de celebración: Swissôtel (The Bosphorus), Estambul (Turquía).

Fecha: del 24 al 26-6-1996.

Título: Some Computational Aspects of Exact Maximum Likelihood Estimation of Time Series Models.

Congreso: XII Symposium on Computational Statistics (COMPSTAT '96).

Entidad organizadora: International Association for Statistical Computing (IASC-ERS).

Lugar de celebración: Universidad Politécnica de Cataluña, Barcelona.

Fecha: del 26 al 30-8-1996.

Título: Applications of Residual Properties in Univariate ARMA Models.

Congreso: XXII Simposio de Análisis Económico.

Entidad organizadora: Departamento de Economía e Historia Económica e Instituto de Análisis Económico (CSIC) de la Universidad Autónoma de Barcelona.

Lugar de celebración: Universidad Autónoma de Barcelona.

Fecha: del 10 al 12-12-1997.

Título: Residuals in Autoregressive-Moving Average Models: Theoretical Finite Sample Properties and Practical Applications.

Congreso: The 19th Annual International Symposium on Forecasting (ISF '99).

Entidad organizadora: International Institute of Forecasters (IIF).

Lugar de celebración: The Capital Hilton, Washington, DC (Estados Unidos).

Fecha: del 27 al 30-6-1999.

Título: An Algorithm for the Exact Likelihood of a Stationary Vector Autoregressive-Moving Average Model.

Congreso: The 20th Annual International Symposium on Forecasting (ISF 2000).

Entidad organizadora: International Institute of Forecasters (IIF).

Lugar de celebración: Hotel Alpha Lisboa, Lisboa (Portugal).

Fecha: del 21 al 24-6-2000.

Título: Residuals in Time Series Models.

Congreso: XVII Symposium on Computational Statistics (COMPSTAT 2006).

Entidad organizadora: International Association for Statistical Computing (IASC-ERS).

Lugar de celebración: DSPSA, Universidad La Sapienza, Roma (Italia).

Fecha: del 28-8 al 1-9-2006.

Título: Computing and using Residuals in Time Series Models.

Congreso: The 29th Annual International Symposium on Forecasting (ISF 2009).

Entidad organizadora: International Institute of Forecasters (IIF).

Lugar de celebración: Sheraton Hong Kong Hotel and Towers, Kowloon (Hong Kong).

Fecha: del 21 al 24-6-2009.

Otros Méritos o Aclaraciones:

El grupo de investigación UCM-CAM 940223 (Econometría en Espacio de los Estados) fue valorado por la ANEP con las calificaciones 54/70 (7-12-2005) y 57/70 (15-12-2006).

El proyecto de investigación SEJ2005-07388/ECON (Técnicas de Subespacios: Aplicaciones a la Modelización y Desagregación de Series Temporales Económicas) fue valorado por la SGPI-DGI del MEC con la calificación MUY SATISFACTORIO (5-10-2007).

La presentación del proyecto de investigación SEJ2005-07388/ECON (Técnicas de Subespacios: Aplicaciones a la Modelización y Desagregación de Series Temporales Económicas) en enero de 2008 dentro de las Jornadas de Seguimiento de Proyectos de Investigación organizadas por el Departamento Técnico de Humanidades y Ciencias Sociales de la SGPI-DGI del MEC, fue valorada con la calificación MUY SATISFACTORIA (7-02-2008).

Miembro de los tribunales encargados de juzgar once tesis doctorales en el Departamento de Fundamentos del Análisis Económico II de la Universidad Complutense de Madrid.

Evaluador anónimo de varios artículos para las revistas *International Journal of Forecasting*, *Journal of The Royal Statistical Society - Series B*, *Revista Española de Economía*, *Journal of Time Series Analysis*, *Computational Management Science*, *Computational Statistics and Data Analysis*, y *Communications in Statistics - Simulation and Computation*.

Secretario Académico del Departamento de Fundamentos del Análisis Económico II (Economía Cuantitativa) de la Universidad Complutense de Madrid, desde el 16-05-1991 hasta el 9-09-1992, y desde el 1-10-2006 hasta el 14-11-2007.

Programa DOCENTIA-UCM: Evaluaciones de la Actividad Docente MUY POSITIVA en el período 2016-2019 y POSITIVA en el período 2020-2023.