



Curriculum vitae

Nombre: ELISEO NAVARRO ARRIBAS

Fecha: 14 de julio de 2.022

DATOS PERSONALES**APELLIDOS:** NAVARRO ARRIBAS **NOMBRE:** ELISEO; **SEXO:** V**OCUPACIÓN ACTUAL**

ORGANISMO: Universidad de Alcalá
CENTRO: Facultad de Ciencias Económicas, Empresariales y Turismo
DEPARTAMENTO: Economía y Dirección de Empresas
CATEGORÍA: Catedrático de Universidad
FECHA DE INICIO: (31-08-95)
DIRECCIÓN POSTAL: Plaza de la Victoria s/n 28802 Alcalá de Henares (Madrid)
TELÉFONO: 918855220; **FAX:** 918854294
CORREO ELECTRÓNICO: Eliseo.Navarro@uah.es
DEDICACIÓN A TIEMPO COMPLETO.

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Mercados de renta fija, Riesgo de interés, Análisis de la estructura temporal de los tipos de interés, Valoración de activos derivados, Gestión de riesgos financieros y actuariales.

FORMACIÓN ACADÉMICA

LICENCIATURA	CENTRO	FECHA
Ciencias Económicas y Empresariales	Universidad de Valencia	Junio 1.984
<i>Premio extraordinario de licenciatura</i>		
DOCTORADO		
Ciencias Económicas y Empresariales	Universidad de Valencia	Julio 1.987
<i>Sobresaliente cum laude</i>		
OTROS		
Postgraduate Diploma in Actuarial Science.	Heriot-Watt University. Edinburgh (Reino Unido)	Junio 1.988
<i>Awarded with distinction</i>		

PUESTOS DOCENTES DESEMPEÑADOS:

<i>Categoría</i>	<i>Área de Conocimiento</i>	<i>Centro</i>	<i>Fecha de inicio</i>	<i>Fecha de término</i>
Profesor Ayudante de clases prácticas	Matemáticas para Economistas	UV	01/12/84	31/11/86
Profesor Colaborador O.M. 21-X-82	Economía Financiera y Contabilidad	UV	01/12/86	30/09/87
Profesor Ayudante L.R.U.	Economía Financiera y Contabilidad	UV	01/10/87	30/09/88
Profesor Titular de Universidad Interino	Economía Financiera y Contabilidad	UV	01/10/88	10/04/89
Profesor Titular de Universidad	Economía Financiera y Contabilidad	UV	11/04/89	30/09/94
(en comisión de servicios)	Economía Financiera y Contabilidad	UCLM	01/10/94	30/08/95
Catedrático de Universidad	Economía Financiera y Contabilidad	UCLM	31/08/95	07/08/11
	Economía Financiera y Contabilidad	UAH	08/08/11	Hasta la fecha

CLAVE: U.V.: Universitat de València (Estudi General)
UCLM: Universidad de Castilla-La Mancha
UAH: Universidad de Alcalá

DOCENCIA IMPARTIDA**LICENCIATURA / GRADO:**

<i>Asignatura</i>	<i>Curso</i>	<i>Centro</i>	<i>Año(s) académico</i>
- Matemáticas para Economistas I.	Primero	UV	1.984-87
- Matemáticas para Economistas II	Segundo	UV	1.988-90
- Introducción a la Matemática de las Operaciones Financieras	Segundo	UV UCLM	1.990-92 2.001-09
- Matemática de las Operaciones Financieras	Primero	UCLM	2003-04 2009-11
- Matemática de las Operaciones Financieras	Cuarto	UV	1.992-94 1994-02
- Mercados e Instituciones Financieras	Cuarto	UCLM	1.994-97
- PYMES (Sector Financiero)	2º ciclo	UCLM	1.996-97
- Valoración de empresas	2º ciclo	UCLM	1.996-97
- Dirección Financiera	2º ciclo	UCLM	1.997-09
	2º Ciclo	UAH	2011-13
- Economía Financiera	2º ciclo	UCLM	1.997-99
- Planificación Financiera		UPV	2002-03
- Análisis de la Operaciones Financieras	Grado	UAH	2012-21

DOCTORADO / MASTER:

<i>Asignatura</i>	<i>Centro</i>	<i>Año(s) Académicos</i>
Técnicas de Análisis y Gestión del Riesgo de Interés	UV	1.991-96
Métodos Matemáticas de las Finanzas		
Economía Financiera	UV	1.993-94
	UJI	1.993-95
Gestión del Riesgo de Interés	UCLM	1.996-99
Activos Financieros Derivados	UCLM	1.994-95
Activos Renta Fija	UCLM	1.999-04
	UCM	2.002-07
Activos Renta fija	UPV	2.008-09
Activos Renta fija	UM	2.008-13; 2016-19
Activos Renta fija	U.J.I	2.009-11
Renta fija y derivados	UAH	2011-22

CLAVE: U.V.: Universitat de València (Estudi General); U.J.I.:Universitat Jaume I. Castellón
 U.C.L.M.: Universidad de Castilla-La Mancha (Albacete); U.C.M.: Universidad Complutense de Madrid (Programa de Doctorado en Finanzas Cuantitativas); U.P.V.: Universidad del País Vasco (Bilbao); U.M.: Universidad de Murcia; UAH: Universidad de Alcalá

EVALUACIÓN DE LA ACTIVIDAD DOCENTE E INVESTIGADORA

Actividad Docente:

Evaluación Positiva (7 quinquenios) 1.985-1.989; 1.990-1.994; 1.995-1.999; 2.000-2.004;
2.005-2.009; 2010-2014; 2015-2019

Actividad Investigadora:

Evaluación Positiva (6 sexenios) 1.986-1.991; 1.992-1.997; 1.998-2.003; 2.004-2.009;
2.010-2.015; 2.016-2.021

PUBLICACIONES**Artículos**

DÍAZ, Antonio; JAREÑO, Francisco; NAVARRO, Eliseo (2022): Yield curve data choice and potential moral hazard: an empirical exercise on pricing callable bonds. *International Journal of Finance and Economics*. Vol. 27(2), pp 2124-2145, April. DOI: <https://doi.org/10.1002/ijfe.2263> (A)

GARCIA-OLALLA, Myriam, NAVARRO, Eliseo y REQUENA, Pilar (2022): Impacte de la COVID-19 i de les mesures per combatre-la en les taxes de mortalitat de la població de les Illes Balears. En ORTE, Carmen. (Dir.) (2.022): *Anuari de l'envelliment. Illes Balears 2.022*. Ed Universitat de les Illes Balears. (CL)

DE LA FUENTE, Iván, NAVARRO, Eliseo y SERNA, Gregorio (2021): Estimating Regulatory Capital Requirements for Reverse Mortgages. An International Comparison. *International Review of Economics & Finance*, 74 pp. 239-252. Doi: <https://doi.org/10.1016/j.iref.2021.03.001> (A)

ATANCE, David; DEBÓN, Ana y NAVARRO, Eliseo (2020): A Comparison of Forecasting Mortality Models Using Resampling Methods. *Mathematics* 2020, 8 (9), 1550 pp:1-21; doi: <https://doi.org/10.3390/math8091550> (A)

ATANCE, David; BALBÁS, Alejandro y NAVARRO, Eliseo (2020): Constructing Dynamic Life Tables with a Single Factor Model. *Decisions in Economics and Finance*, 43 pp: 787-825. <https://doi.org/10.1007/s10203-020-00308-5> (A)

DE LA FUENTE, Iván; NAVARRO, Eliseo y SERNA, Gregorio (2020): Reverse mortgage's risk. Time evolution of VaR in lump-sum solutions. *Mathematics*, 8 (11), 2043. doi: <https://doi.org/10.3390/math8112043> pp1-17 . (A)

DIAZ, Antonio; JAREÑO, Francisco; NAVARRO, Eliseo (2020): Yield curves from different bond data sets. *Review of Derivatives Research*, 23 pp. 191 - 226 (A)

DE LA FUENTE, Iván; NAVARRO, Eliseo y SERNA, Gregorio (2019): Una alternativa per al finançament de les necessitats de les persones grans: la hipoteca inversa. En ORTE, C. (Dir.) (2.019): *Anuari de l'envelliment. Illes Balears 2.019*. Ed Universitat de les Illes Balears. . ISSN: 2174-7997 pp 71-84 (CL)

DÍAZ, Antonio; JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2.019): Zero-coupon interest rates: evaluating three alternative datasets. *Economic Research-Ekonomska Istraživanja* , vol. 32, n. 1 pp. 2987-3014 (A)

DE LA FUENTE, Iván; NAVARRO, Eliseo., SERNA, Gregorio (2018): Estimating the No-Negative-Equity Guarantee in Reverse Mortgages: International Sensitivity Analysis. En

MILI, M.; SAMANIEGO R. y DI FILIPPO P. (eds.): *New Methods for Fixed Income Modeling*. Ed. Springer International Publishing ISBN: 978-3-319-95284-0. pp. 223-240 (CL)

AMATO, Valeria; DÍAZ, Antonio; DI LORENZO, Emilia; NAVARRO, Eliseo y SIBILLO, Marilena (2018): What If Two Different Interest Rates Datasets Allow for Describing the Same Financial Product? In: CORAZZA, M.; DURBÁN, M.; GRANÉ, A.; PERNA, C. y M. SIBILLO (eds): *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*. Springer International Publishing. ISBN 978-3-319-89823-0. Pp 289-294. (CL)

DE LA FUENTE, Iván; NAVARRO, Eliseo., SERNA, Gregorio. (2018): Estimating Regulatory Capital Requirements for Reverse Mortgages: An International Comparison. In: CORAZZA, M.; DURBÁN, M.; GRANÉ, A.; PERNA, C. y M. SIBILLO (eds): *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*. Springer International Publishing. ISBN 978-3-319-89823-0. Pp-301-305 (CL)

ATANCE, David y NAVARRO, Eliseo (2018): A Single Factor Model for Constructing Dynamic Life Tables. In: CORAZZA, M.; DURBÁN, M.; GRANÉ, A.; PERNA, C. y M. SIBILLO (eds): *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*. Springer International Publishing. ISBN 978-3-319-89823-0. Pp-69-74 (CL)

NAVARRO, Eliseo (2017): Formació Financera i Productes d'Estalvi a Llarg Termini. En ORTE, C. (Dir.)(2017): *Anuari de l'envelliment. Illes Balears 2017*. Ed. Universitat de les Illes Balears. ISSN: 2174-7997 pp 95-108 (CL)

NAVARRO, Eliseo (2016): El mercado de Deuda pública en España. Radiografía de una crisis. En CRUZ, S. , DE PABLO, R. y DE LA FUENTE, D. (coord.): (2016): *Avances y retos en economía financiera y empresarial*. Ed. Centro de Estudios Ramón Areces. ISBI 978-84-9961-245-4. PP. 315-328 (CL)

JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2016): European Inflation and Spanish Stock Market. *European Review*, Vol. 24, N° 4, pages 1-22 (SSCI: Area Studies 55/69; 2016; Scimago: Political Science and International Relations 318/404) (A)

MARTÍNEZ SERNA, María I. y NAVARRO, Eliseo (2015): Interest Rate Volatility and Expectations About the Business Cycle. *International Finance*, Volume 18, Issue 1, pages 69–92, Spring 2015. (SSCI: Economics, 228/345; 2015) (A)

NAVARRO, Eliseo; REQUENA, Pilar; SERNA, Gregorio y VITÓN, Esperanza (2014): Instrumentos derivados para la transferencia del riesgo de longevidad y de mortalidad al mercado de capitales. Documentos de investigación de ICEA. Documento nº 240. Diciembre 2014, pp 1-78. (A)

NAVARRO, Eliseo (2014): Cláusulas suelo y tasa anual equivalente. En ALCALÁ, M^a Ángeles (dir.) (2014): *Hacia un nuevo modelo de mercado hipotecario*. Ed Dyckinson, Madrid, pp. 167-190 ISBN: 9788490852187 (C.L.)

LÓPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2013): Interest rate and stock return volatility indices for the Eurozone. Investors' gauges of fear during the recent financial crisis. *Applied Financial Economics*, 23:18 (Scimago: Finance, 129/208) (A)

LÓPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2012): Implied Volatility Indices in the Equity Market: A Review. *African Journal of Business Management*. Vol.6 (50), pp. 11909-11915 (A)

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2011): Term Structure of Volatilities and Estimation Method of the Term Structure of Interest Rates. *Quantitative Finance*, Vol. 11, nº 4. (SSCI: Economics, 168/321) (A)

NAVARRO, Eliseo (2010): El mercado de titulaciones para las PYMES. En ALCALÁ ALONSO, M^a Ángeles (ed.) (2010): *La gestión de la pequeña y mediana empresa y empresa familiar*. Ed. CIVITAS, Madrid (CL)

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2010): A Principal Component Analysis of the Spanish Volatility Term Structure. *International Research Journal of Finance and Economics*, 49 (Scimago: Finance, 143/188) (A)

JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2010): Stock Duration and Inflation Shocks. *European Journal of Operational Research*, 201 (SCI: Operations Research & Management Science: 6/75) (A)

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2010): Estimating the Volatility Term Structure. En CORAZZA, Marco and Claudio PIZZI (eds.) (2009): *Mathematical and Statistical Method for Actuarial Science and Finance*. Ed. Springer. Milano. Pags. 123-131 (CL)

DÍAZ, Antonio; GONZÁLEZ, María de la O y NAVARRO, Eliseo (2009): Stochastic Immunization Strategies based on M-Absolute. En ANGELA, CARRILLO, MICOCCI, NAVARRO, OTTAVIANI and PRESSACCO (eds.)(2009): *New Frontiers in Insurance and Bank Risk Management* (2009). Ed. McGraw-Hill. Milano (CL)

ANGELA, C; CARRILLO MENEDEZ, S; MICOCCI, M.; NAVARRO ARRIBAS, E.; OTTAVIANI, R. y PRESSACCO, F. (eds.)(2009): *New Frontiers in Insurance and Bank Risk Management*. Ed. McGraw-Hill. Milano. (ED)

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O, NAVARRO, Eliseo y SKINNER, Frank (2009): An Evaluation of Contingent Immunization *Journal of Banking and Finance*, 33 (A)

DÍAZ, Antonio; MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (2009): International Evidence on Alternative Models of the Term Structure of Volatilities. *Journal of Futures Markets* Vol. 29, nº 7. (A)

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2008): Mercados españoles de Deuda del Estado: impacto de la Unión Monetaria Europea. *Moneda y Crédito*, Nº 227 (A)

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O; NAVARRO, Eliseo (2008): Bond Portfolio Immunization, Immunization Risk and Idiosyncratic Risk: Spanish Experience. *Revista de Economía Financiera* nº 16. Noviembre. (A)

FERREIRA, Eva; MARTÍNEZ, M^a Isabel; NAVARRO, Eliseo y RUBIO, Gonzalo (2008): Economic Sentiment and Yield Spreads in Europe. *European Financial Management*, vol. 14, nº 2. pp. 206-221 (A)

DÍAZ, Antonio; MERRICK, John y NAVARRO, Eliseo (2006): Spanish Treasury Bond Market Liquidity Pre- and Post- European Monetary Union. *Journal of Banking and Finance*, 30 (A)

NAVARRO, Eliseo y SILLA, Estanislao (2005): Especificaciones Alternativas de la Estructura Temporal de Volatilidades. *Cuadernos Económicos del ICE*, Nº 69. Junio 2005. (A)

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2004): Primas de liquidez entre mercados españoles de Deuda del Estado. El impacto de la Unión Europea. *Revista de la Bolsa de Madrid* Vol. 129, Marzo (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2003): “Testing the Optimality of Immunization Strategies with Transaction Costs. En SANTIAGO CARRILLO (dir.) (2003): *Seminario de Matemática Financiera*. Instituto MEFF-RiskLab. Volumen 3. (CL)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2002): Riesgo y crisis bancarias. En DE JUAN, O. y FEBRERO, E. (2002): *La fragilidad financiera del capitalismo*. Ed. Universidad de Castilla-La Mancha. Cuenca. (CL)

MARTÍNEZ SERNA, María I. y NAVARRO, Eliseo (2002): El modelo de McCallum. Evidencia en la estructura temporal de los tipos de interés española. *Investigaciones Económicas*. Vol. XXVI (2). Mayo. (A)

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2002): Yield spread and term to maturity: default vs. liquidity. *European Financial Management*. Vol. 8. nº 4. Diciembre. (A)

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2002): La prima de liquidez de la Deuda del Estado española. *Revista de Economía Aplicada*. Vol. X n. 29 (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2001): The Structure of Spot Rates and Immunization: Some Further Results. *Spanish Economic Review*. Volume 3, Issue 4. December. (A)

MASSOT, Magdalena; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2001): Estimación de primas temporales a partir de la curva de tipos cupón cero. *Revista Española de Financiación y Contabilidad*, Nº 109. (A)

NAVARRO, Eliseo y TORRÓ, Hipólit (2000): Cobertura dinámica del riesgo de interés con futuros. *Moneda y Crédito*, N. 211. (A)

DIAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (1997): El diferencial de rentabilidad en la deuda privada española. *Revista de Economía Aplicada*. Vol V. nº 14. Otoño. (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1997): Dynamic Immunization and Transaction Costs With Different Term Structure Models. *Journal of Actuarial Practice*. Vol.5, No 2. (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.997): A Two Factor Duration Model for Interest Rate Risk Management. *Investigaciones Económicas*. Vol. XXI (1) Enero. (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.997): Contratos de permuta financiera de intereses. *Cuadernos de Derecho y Comercio*. nº 22. Abril. (A)

ESCRIBANO, Francisco; GENTO, Pedro y NAVARRO, Eliseo (1.996): Estructura financiera y resultados de la empresa castellano-manchega. *Situación. Serie de estudios regionales. Castilla-La Mancha*. Ed. Servicio de Estudios del Banco Bilbao Vizcaya. Bilbao.(CL)

BARREIRA, M^a Teresa; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.996): Métodos alternativos de medición del riesgo de interés en las entidades de crédito; una reflexión. *Análisis Financiero*, 70. Tercer Cuatrimestre. Madrid. (A)

CONTRERAS, Dulce; FERRER, Román; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.996): Análisis factorial de la estructura temporal de los tipos de interés en España. *Revista Española de Financiación y Contabilidad*, Vol. XXV, nº 86. (A)

NAVARRO, Eliseo; FERRER, Román; GONZALEZ, Cristóbal y NAVE, Juan M. (1.995): Tablas de Mortalidad de la Comunidad Valenciana 1.990-91.En *Censos de Població y Habitatges. Monografies. Volum I*. Ed. Generalitat Valenciana. Institut Valencià d'Estadística. Valencia. (CL)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.995): Análisis de los Factores de riesgo en el Mercado Español de Deuda Pública. *Cuadernos Aragoneses de Economía (2ª época) vol. 5 nº 2*. Zaragoza. (A)

NAVARRO, Eliseo; FERRER, Román y NAVE, Juan M. (1.995): La volatilidad de las variaciones de los tipos de interés en la estimación de su estructura temporal. *Revista Europea de Dirección y Administración de la Empresa*, vol. IV. nº 2. (A)

BARREIRA, M^a Teresa; y NAVARRO, Eliseo (1.995): El riesgo de interés y su impacto en el margen financiero de las entidades de crédito: una revisión del *gap de duration*. *Análisis Financiero*, 66. Segundo cuatrimestre. Madrid. (A)

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.994): Inmunización dinámica, riesgo de inmunización y costes de transacción. *Análisis Financiero*, 64. Tercer cuatrimestre. Madrid. (A)

BARREIRA, M^a Teresa y NAVARRO, Eliseo (1.991): Riesgo e innovación financiera: FRA

y swaps. *Actualidad Financiera*. 16. Madrid. (A)

MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (1.990): Una aproximación a la *duration* generalizada y su aplicación a la inmunización financiera. *Cuadernos Actuariales*, 5. Barcelona. (A)

MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (1.988): ¿Es posible la Inmunización financiera?. Expresión General de la *duration* generalizada. *Transactions of the International Congress of Actuaries*. Helsinki. (A)

MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (1.988): ¿Es posible la Inmunización financiera?. Expresión General de la *duration* generalizada. *Anales del Instituto de Actuarios Españoles*, 26. Madrid. (A)

FORES, Dolores; NAVARRO, Eliseo y SALA, Ramón (1.987): La inversión en renta fija a corto plazo: la influencia de los tipos de interés. *Memoria de la Bolsa de Valencia*, 1.986. Valencia. (A)

NAVARRO, Eliseo (1.986): La *duration* y los riesgos de variación de los tipos de interés e insolvencia. *Boletín de la Federación Iberoamericana de Bolsas de Valores*, 9. Buenos Aires. Abril/Junio. (A)

NAVARRO, Eliseo (1.986): La *duration* y los riesgos de variación de los tipos de interés e insolvencia. *Memoria de la Bolsa de Valencia*, 1.985. Valencia. (A)

NAVARRO, Eliseo (1.985): *Duration* y riesgo de insolvencia. *Anales del Instituto de Actuarios Españoles*, 25. Madrid (A)

Clave: (A) Artículo; (CL) Capítulo de Libro.

Libros

NAVARRO, Eliseo (2019): *Matemáticas de las operaciones financieras*. Ed. Pirámide. Madrid. ISBN: 978-84-368-4050-6

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2001): *Fundamentos de Matemáticas Financieras*. Ed. Antoni Bosch. Barcelona. ISBN: 84-95348-01-2

MENEU, Vicente; NAVARRO, Eliseo y BARREIRA, M^a Teresa (1.992): *Análisis y Gestión del Riesgo de Interés*. Ed. Ariel. Barcelona. ISBN: 84-344-2075-9;

NAVARRO, Eliseo (1.991): *Tablas de Mortalidad de la Población Española 1.982. Metodología y Fuentes*. Ed. MAPFRE. Madrid. ISBN: 84-7100-223-X

Otras publicaciones:

MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (1990): Duration: Its role in immunization. *Actas del I Congreso Actuarial Approach for Financial Risks*, vol 2. París, Francia

MENEU, Roberto y NAVARRO, Eliseo (1991): Immunization as a Maximin Strategy: The Effects of Transaction Costs and Imperfect Divisibility of Financial Assets. *Actas del II Congreso Actuarial Approach for Financial Risks*, vol 3, Brighton, Reino Unido

CONTRERAS, Dulce; NAVARRO, Eliseo (1.993): Utilización de *splines* exponenciales para la modelización de la estructura temporal de los tipos de interés en el mercado español. *Quaderns de Treball*, 241. Universitat de València.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1994): Dynamic Immunization and Transaction Costs. *Actas del V Congreso Actuarial Approach for Financial Risks*, vol 1, Orlando, USA.

NAVARRO, Eliseo y TORRÓ, Hipólit (1998): Cobertura dinámica del riesgo de interés con futuros. Una aplicación al mercado interbancario español. *Quaderns de Treball. Facultat de CC.EE. y EE. de la Universitat de Valencia*. Nº 74 (nova època).

NAVARRO, E. y NAVE, J.M. (1998) : Un modelo para la evaluación de la gestión de carteras de renta fija. *Documentos de trabajo de la Facultat de CC. EE. y EE. de la Universidad de Castilla-La Mancha* Volumen:1.1998.2. Albacete.

DÍAZ, A. y NAVARRO, E.(2000): El efecto edad en la liquidez de la Deuda del Estado. *Documentos de trabajo de la Facultat de CC. EE. y EE. de la Universidad de Castilla-La Mancha* Volumen:1.2000.1. Albacete.

MARTÍNEZ SERNA, M^a. I. y NAVARRO, E. (2000): La estructura temporal de los tipos de interés y la política monetaria. Contraste del modelo de McCallum. *Documentos de trabajo de la Facultat de CC. EE. y EE: de la Universidad de Castilla-La Mancha* Volumen:1.2000.2. Albacete.

MASSOT, Magdalena, NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (2000): Estimación de primas temporales de la curva de bonos cupón-cero. *Documents de Treball*, 18, Universitat de les Illes Balears.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2003): Liquidity Premium Between Treasury Asset Markets. *Documentos de trabajo de la Facultat de CC. EE. y EE: de la Universidad de Castilla-La Mancha*.

NAVARRO, Eliseo y REQUENA, Pilar (2022): Impacto del COVID-19 y las medidas antipandemia sobre las tasas de mortalidad de la población Española en 2020. *Actuarios*. Primavera 2022. Nº 50 (A)

ARTÍCULOS EN PROCESO DE EVALUACIÓN

NAVARRO, Eliseo y REQUENA, Pilar (2022) Descriptive Analysis of the Impact of COVID-19 and Anti-Pandemic Measures on Mortality Rates in the Spanish Population in 2020 Using Graduation Techniques (March 22, 2022). Available at SSRN: <https://ssrn.com/abstract=4063837> or <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.4063837>

FUENTE, Iván de la ; NAVARRO, Eliseo y SERNA, Gregorio (2022) : Proposal for Calculating Regulatory Capital Requirements for Reverse Mortgages. Available at SSRN: <https://ssrn.com/abstract=4068651> or <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.4068651>

PARTICIPACIÓN EN CONTRATOS Y PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN FINANCIADOS EN CONVOCATORIAS PÚBLICAS.

TITULO DEL PROYECTO: Modelización y análisis de la estructura temporal de los tipos de interés en España.

ENTIDAD FINANCIADORA: Universitat de València (Proyectos precompetitivos de investigación)

DURACIÓN: Desde Septiembre 1.994 Hasta: Septiembre 1.995

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: Estructura Temporal de los tipos de interés y actividad económica real. BEC2001-1599

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Ciencia y Tecnología. Dirección General de Investigación.

DURACIÓN: Desde 28 diciembre 2001 Hasta: 27 diciembre 2004

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: Análisis de la sensibilidad del valor de las empresas ante las variaciones de los tipos de interés. PAC-02-001

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Investigación e Innovación. Junta de Comunidades de Castilla-La Mancha

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2002 Hasta: 31 de diciembre 2004

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: Tablas de Mortalidad de la Comunidad Valenciana años 2000-2001. Evolución reciente de las tendencias de mortalidad y proyecciones.

ENTIDAD FINANCIADORA: Dirección General de Investigación e Innovación. Generalitat Valenciana

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2003 Hasta: 31 de diciembre 2003

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Roberto Escuder Vallés

TITULO DEL PROYECTO: Estimación y análisis de la estructura temporal de volatilidades y su interrelación entre las principales áreas monetarias. SEJ2005-08931-C02-01

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Educación y Ciencia. Dirección General de Investigación.

DURACIÓN: Desde 15 de octubre de 2005 Hasta: 15 de octubre de 2008

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro Arribas

TITULO DEL PROYECTO: Análisis de la estructura temporal de volatilidades y gestión del riesgo de interés. ECO2008-05551/ECON

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Educación y Ciencia. Subdirección General de Proyectos de Investigación.

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2009 Hasta: 31 de diciembre de 2011

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro Arribas

TITULO DEL PROYECTO: Análisis del riesgo en mercados de renta fija ECO2011-28134

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Educación y Ciencia. Subdirección General de Proyectos de Investigación.

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2012 Hasta: 31 de diciembre de 2014

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Antonio Díaz Pérez

TITULO DEL PROYECTO: Impacto del riesgo en la valoración de los activos de renta fija ECO2014-59664-P

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Economía y Competitividad

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2015 Hasta: 31 de diciembre de 2017

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Antonio Díaz Pérez

TITULO DEL PROYECTO: Análisis del riesgo en los mercados financieros, ECO2017-89715-P

ENTIDAD FINANCIADORA: Ministerio de Economía y Competitividad

DURACIÓN: Desde 1 de enero de 2018 Hasta: 31 de diciembre de 2021

INVESTIGADOR RESPONSABLE: Antonio Díaz Pérez

PARTICIPACIÓN EN CONTRATOS DE I+D DE ESPECIAL RELEVANCIA CON EMPRESAS Y/O ADMINISTRACIONES

TITULO DEL PROYECTO: **La inmunización financiera.**
ENTIDAD FINANCIADORA: Instituto de Estudios Fiscales.
DURACIÓN: Desde 16-Sept-86 Hasta: 16-Sept-87.
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: **Tablas de mortalidad de la Comunidad Valenciana**
ENTIDAD FINANCIADORA: Institut Valencià d'Estadística
DURACIÓN: Desde Diciembre 1.993 Hasta: Agosto 1.994
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: **Eficiencia y distribución de los fondos de inversión en España**
ENTIDAD FINANCIADORA: Instituto Valenciano de Investigaciones Económicas
DURACIÓN: Desde Febrero 1.995 Hasta: Octubre 1.995
INVESTIGADOR RESPONSABLE: M^a Paz Jordá Durá

TITULO DEL PROYECTO: **Análisis y desarrollo de modelos de gestión del riesgo de interés para su aplicación a entidades de crédito"**
ENTIDAD FINANCIADORA: Caja Rural Valencia y Fundación Universidad Empresa de Valencia-ADEIT.
DURACIÓN: Desde Septiembre 1.996 Hasta: Marzo 1.998
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: **Tablas de mortalidad de colectivos asegurados de la población española 1997-98**
ENTIDAD FINANCIADORA: Instituto de Actuarios Españoles
DURACIÓN: Desde febrero 2000 Hasta: febrero 2001
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro.

TITULO DEL PROYECTO: **Integración y Eficiencia de los Mercados de Renta fija en Europa**
ENTIDAD FINANCIADORA: Fundación BBVA
DURACIÓN: Desde junio de 2005 Hasta: Junio de 2006
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eva Ferreira García

TITULO DEL PROYECTO: **"Técnicas de gestión del riesgo de longevidad relacionadas con le mercado de capitales"**
ENTIDAD FINANCIADORA: Investigación Cooperativa entre Entidades Aseguradoras y fondos de Pensiones (ICEA)
DURACIÓN: Desde 1 de octubre de 2013 Hasta: 1 de 31 de julio de 2014
INVESTIGADOR RESPONSABLE: Eliseo Navarro Arribas

ESTANCIAS EN CENTROS EXTRANJEROS

CENTRO: Heriot-Watt University
LOCALIDAD: Edimburgo; PAÍS: Reino Unido.
PERÍODO: Septiembre 1.987- Junio 1.988.
TEMA: Matemática y Estadística Actuarial.

ESTANCIAS EN OTROS CENTROS DE INVESTIGACIÓN

CENTRO: Universidad del País Vasco. Dpto. de Fundamentos de Análisis Económico II
LOCALIDAD: Bilbao
PERÍODO: Marzo 2003 - Junio 2003
TEMA: Economía Financiera

PONENCIAS Y COMUNICACIONES PRESENTADAS A CONGRESOS

MENEU, Vicente y NAVARRO, Eliseo (1.990): "Duration: Its Role in immunization". *Actuarial Approach for Financial Risks, vol. 2*. París.

MENEU, Robert y NAVARRO, Eliseo (1.991): "Immunization as a Maximin Strategy: The Effects of Transaction Costs and Imperfect Divisibility of Financial Assets". *Actuarial Approach for Financial Risks, vol. 3*. Brighton.

DEVESA, Enrique; NAVARRO, Eliseo y VIDAL, Carlos (1.992): "Estimación de la mortalidad de la población de la Comunidad Valenciana". *I Congreso Iberoamericano de Investigación Operativa*. Cáceres, 29 septiembre a 2 de octubre.

CONTRERAS, Dulce y NAVARRO, Eliseo (1.993): "The Use of Exponential Splines for the Estimation of the Intertemporal term Structure of Interest Rates". *ASSET Meeting*. Barcelona, 15-16 de octubre.

MENEU, Robert y NAVARRO Eliseo (1.993): "Influencia de los Costes de Transacción en una Estrategia Inmunizadora". *I Foro de Finanzas*. Sevilla, 18-20 de noviembre.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.994): "Dynamic Immunization and Transaction Costs". *Actuarial Approach for Financial Risks, vol. 1*. Orlando.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.994): "Reestructuración óptima en un contexto inmunizador". *II Congreso de Matemáticas de las Operaciones Financieras*. Alicante, 17-18 marzo

NAVARRO, Eliseo (1.994): "Análisis de *duration* de bonos indizados". *II Congreso de Matemáticas de las Operaciones Financieras*. Alicante, 17-18 marzo.

CONTRERAS, Dulce; FERRER, Román; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.994): "Análisis Factorial de la Estructura Temporal de los tipos de interés en España". *IV Congreso Hispano Francés AEDEM*. Cáceres, 7-10 de junio.

FERRER, Román; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.995): "A Two Factor Duration Model for Interest Rate Risk Estimation". *Actuarial Approach for Financial Risks, vol. 4*. Bruselas.

NAVARRO, Eliseo; FERRER, Román y NAVE; Juan M. (1.995): "La volatilidad de los tipos de interés en la estimación de su estructura temporal". *V Congreso Hispano-Francés AEDEM*. Toledo, 2-5 de mayo.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.995): "Evolución de la mortalidad de la población de la Comunidad Valenciana". *XV Jornadas de la Salud*. Valencia, 24-26 de mayo.

CONTRERAS, Dulce; FERRER, Román; NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.995): "Análisis de duración a partir de un modelo bifactorial empírico de la estructura temporal de los tipos de interés". *II Jornadas de Economía Financiera*. Bilbao, 15-16 de junio.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.995): "Dinámica de la estructura temporal de los tipos de interés del mercado español". *III Congreso de Matemática de las Operaciones Financieras*. Las Palmas de Gran Canaria, 27-29 de octubre.

ESCRIBANO, Francisco; GENTO, Pedro y NAVARRO, Eliseo (1.995): "Duration y riesgo de insolvencia en renta fija". *III Foro de Finanzas*. Bilbao, 30 de Noviembre-1 de Diciembre.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.996): "A Two Factor Duration Model for Interest Rate Risks Management". *Workshop on Risk Management and Value at Risk for Financial Institutions*. EIASM. Bruselas, 25-26 de Enero.

ESCRIBANO, Francisco; GENTO, Pedro y NAVARRO, Eliseo (1.996): "Modelos teóricos sobre duration de títulos de renta fija con riesgo de insolvencia". *X Reunión ASEPELT-España*. Albacete, 20-21 de junio.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1.996): "Un modelo para la evaluación de la gestión de carteras de renta fija". *IV Foro de Finanzas*. Madrid, 14-15 de noviembre.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (1997): "Estudio de la dependencia del diferencial de rentabilidad y plazo hasta el vencimiento en la deuda privada española". *V Foro de Finanzas*. Benalmádena, 13 y 14 de Noviembre.

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan M. (1997): "Dynamic Immunization and Transaction Costs Under Different Term Structure Regimes". *IV Congreso de Matemáticas Financieras*. Barcelona, 26, 27 y 28 de Noviembre.

NAVARRO, Eliseo; NAVE, Juan M. y MENEU, Vicente (1998): "Testing the Optimality of Immunization Strategies with Transaction Costs". *First Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics*. Almería 28-30 de mayo.

NAVARRO, Eliseo y TORRÓ, Hipòlit (1998): "Cobertura Dinámica del Riesgo de Interés con Futuros: Una Aplicación al Mercado Interbancario Español". *III Jornadas de Economía Financiera*. Bilbao, 18-19 de Junio.

MASSOT, M, NAVARRO, E. y NAVE, J.M. (1999): Estimación de las primas temporales a partir de la curva de bonos cupón cero. *II Encuentros de Economía Aplicada*. Zaragoza 3-5 de Julio.

NAVARRO, E. Y NAVE, J.M. (1999): The Structure of Spot Rates and Immunization: Some Further Results. *II Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics*. Nápoles (Italia). 1-4 de julio

MARTÍNEZ SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, E. (2000): La estructura temporal de los tipos de interés y la política monetaria. *I Jornadas sobre estructura temporal de los tipos de interés*. Instituto Complutense de Análisis Económico. Madrid. 24 de marzo

DÍAZ, Antonio Y NAVARRO, Eliseo (2000): El diferencial de rentabilidad de la renta fija privada y su relación con el plazo. *V Congreso de Matemáticas Financiera y III Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics*. Universidad del País Vasco. Bilbao. 26-28 de Abril

MARTÍNEZ SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, Eliseo (2000): The Expectations Theory of the Term Structure of Interest Rates and Monetary Policy. 2000 EFMA Meeting. Atenas. 28 de junio-1 de julio

NAVARRO, Eliseo y NAVE, Juan Miguel (2001): Testing the Optimality of Immunization Strategies with Transaction Costs. *V Foro de Finanzas de Segovia*. Caja de Ahorros de Segovia y Analistas Financieros Internacionales. 3-5 de julio

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2001): Yield spread ant term to maturity. *IV Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Universidad de Sassari (Italia) 2-5 de julio.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2001): Yield Spread and Term to Maturity: Default vs. Liquidity. *IX Foro de Finanzas*. Universidad Pública de Navarra. Pamplona, 15-16 de noviembre.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2002): La prima de liquidez en la Deuda del Estado española *V Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Universidad de Valencia 20-22 de junio.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2002): Yield Spread and Term to Maturity: Default vs. Liquidity. *2002 EFMA Meeting*. Londres. 27-30 de junio

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2003): Liquidity Premium Between Treasury Asset Markets. *2003 EFMA Meeting*. Helsinki. 25-28 de junio

MARTÍNEZ SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, Eliseo (2003): The Term Structure of Interest Rates and Expected Economic Growth. *2003 EFMA Meeting*. Helsinki. 25-28 de junio

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2003): Liquidity Premium Between Treasury Asset Markets. *VI Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Universidad de Trieste. 3-5 de julio.

FERREIRA, Eva; MARTÍNEZ, M^a Isabel; NAVARRO, Eliseo y RUBIO, Gonzalo (2003): Real Activity and Yield Spreads Under Consumption Based Capital Asset Pricing Models. *VI Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Universidad de Trieste. 3-5 de julio.

FERREIRA, Eva; MARTÍNEZ, M^a Isabel; NAVARRO, Eliseo y RUBIO, Gonzalo (2003): Real Activity and Yield Spreads Under Consumption Based Capital Asset Pricing Models. *XI Foro de Finanzas*. Universidad de Alicante, Alicante. 13-14 diciembre.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2003): Liquidity Premiums Between Spanish Treasury Markets. *XI Foro de Finanzas*. Universidad de Alicante, Alicante. 13-14 diciembre.

DÍAZ, Antonio y NAVARRO, Eliseo (2004): Liquidity Premiums Between Spanish Treasury Markets: the Impact of European Monetary Union. *Internacional Bond and Debt Market Integration Conference*. Dublín (Irlanda) 31 mayo-1 junio

DÍAZ, Antonio; MERRICK, John y NAVARRO, Eliseo (2004): Spanish Treasury Bond Market liquidity Pre- and Post- European Monetary Union. *2004 EFMA Meeting*. Basilea (Suiza), 30 junio-3 julio.

DÍAZ, Antonio; MERRICK, John y NAVARRO, Eliseo (2004): Spanish Treasury Bond Market liquidity Pre- and Post- European Monetary Union. *VII Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Universidad de Castilla-La Mancha, 8-9 de Julio, Cuenca.

DÍAZ, Antonio; MERRICK, John y NAVARRO, Eliseo (2004): Spanish Treasury Bond Market liquidity Pre- and Post- European Monetary Union. 3rd Finance Conference-Portugueses Finance Network. Lisboa (Portugal) 15-16 de julio

DÍAZ, Antonio; MERRICK, John y NAVARRO, Eliseo (2004): Spanish Treasury Bond Market liquidity Pre- and Post- European Monetary Union., *XII Foro de Finanzas*, 9-10 de diciembre, Barcelona.

NAVARRO, Eliseo Y SILLA, Estanislao (2005): International Evidence About Alternative Models of the Term Structure of Volatilities. *VIII Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*. Università de gli Studi de Milano-Bicocca & Università Catolica del Sacro-Cuore. Verbania (Italia) 30 junio-1 julio

JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2006) : Stock Duration and Inflation shocks. *XXX Convengo AMASES*. Università di Trieste. Trieste (Italia). 4-7 de septiembre

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2006): Testing Contingent Immunization: Evidence from the Spanish Treasury Market. *XXX Convengo AMASES*. Università di Trieste. Trieste (Italia). 4-7 de septiembre

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2006): Testing Contingent Immunization: Evidence from the Spanish Treasury Market. IX Congreso Hispano-Italiano de Matemáticas Financieras. Universidad de Alcalá de Henares (Madrid). 21-22 de septiembre

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2006): Testing Contingent Immunization: Evidence from the Spanish Treasury Market. *Convengo MAF 2006, Metodi Matematici e Statistici per le Assicurazioni e la Finanza* Salerno (Italia) 11-12-13 de octubre.

JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2006): Stock Duration and Inflation shocks. *XIV Foro de Finanzas*. Universitat Jaume I. Castellón. 15-17 de noviembre.

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2006): Bond Portfolio Immunization, Immunization Risk and Idiosyncratic Risk: Spanish Experience. *XIV Foro de Finanzas*. Universitat Jaume I. Castellón. 15-17 de noviembre.

JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2007): Stock Interest Rate Risk and Inflation Shocks. *2007 EFMA Meeting..* Vienna University of Economics and Business Administration, Vienna (Austria), 27 - 30 de Junio..

DÍAZ, Antonio, GONZÁLEZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2007): Testing Contingent Immunization: Evidence from the Spanish Treasury Market. *XV Foro de Finanzas*. Universitat de les Illes Balears, 15-17 de noviembre

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2008): Term Structure of Volatilities and Estimation Method of the Term Structure of Interest Rates. *Convengo MAF 2008, Metodi Matematici e Statistici per le Assicurazioni e la Finanza* Venecia (Italia) March 26, 29

NAVARRO, Eliseo (2008): Efecto de las *subprime* en la economía global. *IV Jornadas sobre mercados financieros y análisis bursátil*. Universidad de Castilla-La Mancha. Cuenca, 23-24 de abril.

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2008): Term Structure of Volatilities and Estimation Method of the Term Structure of Interest Rates. *X Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics* 23-25 de Junio, Università di Cagliari, Italia

DÍAZ, Antonio; GONZÁLEZ, María de la O y NAVARRO, Eliseo (2008): Stochastic Immunization Strategies vs M-Absolute Strategies. *X Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics* 23-25 de Junio, Università di Cagliari, Italia

DÍAZ, Antonio, JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2008): Term Structure of Volatilities and Estimation Method of the Term Structure of Interest Rates. *2008 Annual EFMA Meeting*. Atenas (Grecia) 25-28 Junio

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, Eliseo (2008): Informative content of implied interest rate volatility about economic expectations: Evidence from Germany and the U.K. *XVI Foro de Finanzas* .ESADE , Barcelona 14-15 de noviembre

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, Eliseo (2009): Informative content of

implied interest rate volatility about economic expectations: Evidence from Germany and the U.K. INFINITI Conference on International Finance. Trinity College, Dublín, Irlanda 8-9 de Junio 2009.

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel y NAVARRO, Eliseo (2009): Informative content of implied interest rate volatility about economic expectations: Evidence from Germany and the U.K. *XI Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics* 2-4 de Julio. Universidad de Extremadura. Badajoz

LÓPEZ, Raquel. y NAVARRO, Eliseo (2009): Construction of an Implied Volatility Index of Forward Rates in the U.S. Interest Rate Cap Market. Methodology and Analysis. *XI Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics* 2-4 de Julio. Universidad de Extremadura. Badajoz

DÍAZ, Antonio ; JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2009): Term Structure of Volatilities and Method for Estimating the Term Structure of Interest Rates. *16th Annual Conference of the Multinational Finance Society* . June, 28-July, 1. Department of Economics - University of Crete, Rethymno, Crete (Greece).

DÍAZ, Antonio ; JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2010): Yield Curve and Volatility for the US Treasury Market. *Fourth International Conference of Mathematical and Statistical Method for Actuarial Sciences and Finance (MAF 2010)* Univesitá di Salerno y Univesitá di Venecia. 7- 9 April 2010 Villa Rufolo - Ravello, Italy

CLAES, A.G.P.; DE CEUSTER, M.J.K.; **LOPEZ, R y NAVARRO, E. (2010):** The US Implied Volatility Index of Forward Interest Rates. *2010 Annual EFMA Meeting*. Aarhus (Dinamarca) 23-26 Junio

DÍAZ, Antonio ; JAREÑO, Francisco y NAVARRO, Eliseo (2010): Yield Curve and Volatility for the US Treasury Market. *17th Annual Meeting of the Multinational Finance Society. Department of Finance and Business. Universitat Pompeu Fabra.* Barcelona 27-30 Junio

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel; LÓPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2012) : The Role of Implied Volatility for Explaining Consumer Sentiment: Evidence for the U.S. and Germany. *Mathematical and Statistival Methods for Actuarial Sciences and Finance (MAF 2012)* . Venecia (Italia) 10-12 de abril.

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel; LÓPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2012) : The Role of Implied Volatility for Explaining Consumer Sentiment: Evidence for the U.S. and Germany. *16th International Conference on Macroeconomic Analysis and International Finance. Rethymo, Creta (Grecia)* 24-26 mayo./

MARTÍNEZ-SERNA, M^a Isabel; LÓPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2012) : The Role of Implied Volatility for Explaining Consumer Sentiment: Evidence for the U.S. and Germany. *European Financial Management Association (EFMA 2012)*. Barcelona 27-30

junio.

DÍAZ, Antonio; GONZAÉZ, M^a de la O y NAVARRO, Eliseo (2012): Diversified, stochastic and contingent Immunization strategies in the Spanish Treasury Market. *XIII Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics (IbIt 2012)*. Cividale del Friuli (Italia). 5-7 julio

LOPEZ, Raquel y NAVARRO, Eliseo (2012): Constructing interest rate volatility indices over short- and long-term horizons. *XIII Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics (IbIt 2012)*. Cividale del Friuli (Italia). 5-7 julio

CONFERENCIAS, SEMINARIOS Y PONENCIAS INVITADAS DE ESPECIAL RELEVANCIA

- TITULO: "Análisis y comparación de las tablas de mortalidad de la población española"
 ACTO: Presentación de la Tablas de Mortalidad de la Población Española 1.982.
 LUGAR Y FECHA: Auditorio MAPFRE-Vida. Madrid, junio 1.991.
- TITULO: "Estimación de la estructura temporal de los tipos de interés mediante funciones *splines*"
 ACTO: Seminario del Dpto. de Economía Aplicada de la Universidad del País Vasco.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Universidad del País Vasco. Bilbao, febrero, 1.994.
- TITULO: "Riesgo sobre Tipo de interés"
 ACTO: Seminario del Dpto. de Economía y Empresa de la Universitat de les Illes Balears
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas Universitat de les Illes Balears. Palma de Mallorca, enero 1.995
- TITULO: "Modelos estocásticos de la estructura temporal de los tipos de interés"
 ACTO: Seminario de Investigación Interdepartamental de la Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de la Laguna
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y empresariales de la Universidad de La Laguna. San Cristóbal de La Laguna, enero, 1.995
- TITULO: "Els mercats de renda fixa: el risc de variació de preus"
 ACTO: Cursos d'estiu 95. L'inversor i els mercats borsaris.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales de Universitat Jaume I. Castellón, septiembre, 1.995.
- TITULO: "Un modelo de duración de dos factores para la gestión del riesgo de interés"
 ACTO: Seminario del Departament d'Economia i Empresa
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Universitat de les Illes Balears. Palma de Mallorca, febrero de 1.996
- TITULO: "Estructura temporal de los tipos de interés"
 ACTO: Seminari de recerca en economia
 LUGAR Y FECHA: División de Ciències Jurídiques, Econòmiques i Socials. Universitat de Barcelona, marzo 1996.

- TITULO: "Un modelo para la evaluación de carteras de renta fija"
 ACTO: Seminario del Departamento de Economía de la Empresa
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales. Universidad Carlos III. Getafe, noviembre 1.996.
- TITULO: "Modelización de la estructura temporal de los tipos de interés en España"
 ACTO: Seminario del Departamento de Economía Financiera
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales. Universidad Alicante. Alicante febrero de 1.997
- TITULO: "Modelos estocásticos de la estructura temporal de los tipos de interés "
 ACTO: Seminario de Doctorado (1 ct.). Programa de doctorado en Economía Financiera de la Universidad de Valencia.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales. Universidad de Valencia. Valencia. Junio de 1.997
- TITULO: Fundamentos de la estructura temporal de los tipos de interés.
 ACTO: Seminario de Doctorado (1 ct.). Programa de doctorado en Economía Financiera de la Universidad de Valencia.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales. Universidad de Valencia. Valencia. Julio de 1.998
- TITULO: Evolución de la mortalidad de la población en España 1980-1990.
 ACTO: Seminario del Departamento de Economía Financiera de la Universidad de Alcalá de Henares.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Empresariales. Universidad de Alcalá. Diciembre de 1.998.
- TITULO: Análisis del diferencial de rentabilidad en la deuda privada en España
 ACTO: Seminario de Tercer Ciclo del Dpto. de Economía y Empresa de la Universidad de las Islas Baleares
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de las Islas Baleares. Junio 1999
- TITULO: Estructura de los tipos de interés y política monetaria
 ACTO: Seminario de Doctorado del Departamento de Economía Financiera de la Universidad de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Valencia. Junio 1999
- TITULO: Testing the Optimality of Immunization Strategies with Transaction Costs
 ACTO: Seminario de Matemáticas Financieras
 LUGAR Y FECHA: MEFF, Madrid, mayo 2001

- TITULO: Riesgo y Crisis Bancarias
 ACTO: Curso de verano de la UCLM. “Fragilidad el sistema capitalista”
 LUGAR Y FECHA: Salón de Actos de la Caja Casilla La Mancha, Albacete junio 2001
- TITULO: Modelos en tiempo continuo de la estructura temporal de los tipos de interés
 ACTO: Seminario de doctorado de la Universidad del País Vasco
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Bilbao, diciembre 2001
- TITULO: Liquidity premiums between Treasury Asset Markets
 ACTO: Brown Bag Seminars del Departamento de Fundamentos de Análisis Económico II de la Universidad del País Vasco
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Bilbao, mayo 2003
- TITULO: Liquidity Premiums between Treasury Asset Markets
 ACTO: Presentación y discusión de trabajos de investigación de Bolsa de Madrid
 LUGAR Y FECHA: Salón de Actos de la Bolsa de Madrid, marzo 2004 (presentado por Antonio Díaz)
- TITULO: Stock Duration and Inflation Shocks
 ACTO: Seminario Investigación Departamento de Economía Financiera, Contabilidad y Marketing de la Universidad de Alicante
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Alicante, 9 de junio de 2006
- TITULO: Contingent Immunization
 ACTO: Seminario Investigación Departamento de Organización de Empresas de la Universidad de Murcia
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Murcia , 4 de junio de 2007
- TITULO: Reflexiones sobre la crisis *subprime*
 ACTO: Clausura del Diploma de Especialización Profesional Univesitario en Bolsas y Mercados Financieros Españoles. Universitat de Valencia y Bolsa de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Fundació Universitat-Empresa ADEIT-Universitat de Valencia 11 de marzo 2008
- TITULO: Reflexiones sobre la crisis *subprime*
 ACTO: Seminario de doctorado de la Universidad de Valladolid.
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Valladolid. 17-18 de abril de 2008

- TITULO: Reflexiones sobre la crisis *subprime*
 ACTO: Seminario de doctorado de la Universidad de Murcia
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Murcia. 29 de abril de 2008
- TITULO: Reflexiones sobre la crisis *subprime*
 ACTO: Conferencia de la Cátedra Santander-Universidad de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Valencia . 15 de mayo de 2008
- TITULO: El origen de la crisis: génesis de la crisis *subprime*
 ACTO: Ciclo de conferencias: “La crisis económico financiera: perspectiva de futuro” organizado por la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de Albacete y la Federación de Empresarios de Albacete
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de Albacete, Albacete 7 de noviembre de 2008
- TITULO: La titulización de préstamos *subprime* y la crisis de 2007
 ACTO: Clausura del Diploma de Especialización Profesional Universitario en Bolsas y Mercados Financieros Españoles. Universitat de Valencia y Bolsa de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Fundació Universitat-Empresa ADEIT-Universitat de Valencia 12 de marzo 2009
- TITULO: Some Issues About Interest Rate Volatility
 ACTO: Conferencia plenaria XXXIV AMASES Conference
 LUGAR Y FECHA: Università degli Studi di Macerata, Macerata (Italia).1 de septiembre de 2010
- TITULO: Mercados financieros y Economía Real
 ACTO: Ecotertulias del Departamento de Análisis Económico y Finanzas de la Universidad de Castilla-La Mancha
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Castilla-La Mancha, Albacete, Noviembre de 2011
- TITULO: Constructing interest rate volatility indices over short and long term horizons
 ACTO: Conferencia invitada “*Giornata di studio: Volatilità e rischio in finanza*”
 LUGAR Y FECHA: Università degli Studi di Salerno. 21 de diciembre de 2011
- TITULO: Mercados Financieros y Economía Real
 ACTO: Ciclos de conferencias convenio colaboración Ibercaja-UAH
 LUGAR Y FECHA: Salón de Actos de Obra Social de Ibercaja. Guadalajara, 10 de enero de 2012

- TITULO: Aportaciones a la Gestión Hospitalaria
 ACTO: Mesa Redonda X Congreso Sociedad española de electromedicina e Ingeniería Clínica
 LUGAR Y FECHA: Barcelona, 26 de septiembre de 2012
- TITULO: El mercado español de deuda pública: La gestación de una crisis
 ACTO: Clausura Master en Ciencias Actuariales y Financieras Universitat de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Facultat de Economía de la Universitat de València. Valencia , 24 de noviembre de 2012
- TITULO: El mercado español de deuda pública: La gestación de una crisis
 ACTO: Clausura Diploma de Especialización Profesional Universitario de Bolsa y Mercados Españoles
 LUGAR Y FECHA: Fundación Universidad – Empresa ADEIT-Universitat de Valencia, 12 de marzo 2013
- TITULO: El mercado español de deuda pública. España en crisis
 ACTO: IV Jornadas sobre Productos Financieros y su Fiscalidad
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Derecho y Ciencias sociales de la UCLM. Ciudad Real, 24 de abril de 2013
- TITULO: The Spanish Public Debt Market: Lessons from the crisis
 ACTO: Jornada de Investigación del Master en Técnicas Cuantitativas para el Sector Asegurador. Mortality and Financial Risks : new challenges and perspectives.
 LUGAR Y FECHA: Universidad Carlos III de Madrid, Getafe, 28 de mayo de 2015
- TITULO: El mercado español de deuda pública. Lecciones de una crisis
 ACTO: Clausura Master en Entidades de Crédito de la Universidad de Castilla-La Mancha
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la UCLM. Albacete, 8 de octubre de 2015
- TITULO: Cláusulas suelo.
 ACTO: Seminario de la Cátedra Finanzas Internacionales Universitat de Valencia- Banco Santander
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Economía de la Universidad de Valencia. 16 de noviembre de 2015
- TITULO: Pricing the No-negative- Equity Guarantee in Lump- sum Reverse Mortgages: An International Comparative Study
 ACTO: Workshop in “Emerging Trends in Banking Research. ACEDE/Santander Financial Institute
 LUGAR Y FECHA: Fundación UCEIF, Santander; 3 de abril de 2017

- TITULO: A Single Factor Model for Constructing Dynamic Life Tables
 ACTO: DISES Seminar Cycle organised by Department of Economics and Statistics de la Universidad de Salerno (Italia)
 LUGAR Y FECHA: Università degli Studi di Salerno, Salerno (Italia) . 7 de enero de 2018
- TITULO: A Single Factor Model for Constructing Dynamic Life Tables
 ACTO: Seminario: “Métodos en la construcción de tablas de mortalidad”. Cátedra de Finanzas Internacionales Universitat de València / Santander Universidades
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Economía. Universidad de Valencia . 9 de marzo de 2018
- TITULO: A Single Factor Model for Constructing Dynamic Life Tables
 ACTO: UnisActuarial School 2.018. Università di Salerno
 LUGAR Y FECHA: Peastum (Italia), 20 de septiembre de 2018
- TITULO: Mercados Financieros y Economía Real
 ACTO: Ciclos de conferencias convenio colaboración Ibercaja-UAH
 LUGAR Y FECHA: Salón de Actos de Obra Social de Ibercaja. Guadalajara, 2 de octubre de 2018
- TITULO: Estimating Regulatory Capital Requirements for Reverse Mortgages: an International Comparison
 ACTO: II Jornadas Demográfico-Actuariales : Longevidad. Organizado por la Cátedra de Finanzas Internacionales Banco Santander/Universitat de Valencia
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Economía. Universidad de Valencia. 4 de marzo de 2019
- TITULO: New Developments in mortality models based on key age mortality rates
 ACTO: Ponencia invitada; 06 Workshop on Pensions and Insurance
 LUGAR Y FECHA: Universidad de Barcelona. 25-26 de marzo de 2021
- TITULO: Impacto del COVID en los mercado financieros
 ACTO: XXV Jornadas de Bolsa y Mercados Financieros
 LUGAR Y FECHA: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la UCLM, Albacete. 1 de abril de 2022
- TITULO: Perspectivas de inflación y tipos de interés
 ACTO: Acto de Clausura del Master Universtario en Análisis Económico Aplicado
 LUGAR Y FECHA: Paraninfo de la Universidad de Alcalá. 10 de junio de 2022
- TITULO: Expectativas sobre inflación y tipos de interés. Qué nos dicen los mercados financieros
 ACTO: 3er Congreso Nacional sobre la Enseñanza de la Economía
 LUGAR Y FECHA: Confederación estatal de profesores de enseñanza secundaria de Economía. <https://ceapes.org/index.php/item/142-3-congreso-nacional-sobre-la-ensenanza-de-la-economia-13-y-14-de-junio-on-line>

TESIS DOCTORALES DIRIGIDAS:

(1)

AUTOR: Torró i Enguix, Hipòlit

TITULO: Estratègies de Cobertura del Risc de Tipus d'Interés en les Carteres de Renda Fixa

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de la Universitat de Valencia

FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 1.997

CALIFICACIÓN: Apto Cum Laude por unanimidad

(2)

AUTOR: Nave Pineda, Juan Miguel

TITULO: Estructura Temporal de los Tipos de Interés e Inmunización Financiera en el Mercado Español

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de la Universitat de Valencia

FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 1.998

CALIFICACIÓN: Apto Cum Laude por unanimidad (**PREMIO EXTRAORDINARIO DE DOCTORADO UNIVERSIDAD DE VALENCIA 1999**)

(3)

AUTOR: Antonio Díaz Pérez (codirigida con Ángeles Fernández Izquierdo)

TÍTULO: Valoración de la renta fija privada en los mercados españoles

LUGAR: Facultad de Ciencias EE. y EE. de la Universidad de Valencia

FECHA: Julio 1999

CALIFICACIÓN: Apto Cum Laude por unanimidad (**PREMIO EXTRAORDINARIO DE DOCTORADO UNIVERSIDAD DE VALENCIA 2001**)

(4)

AUTOR: Román Ferrer Lapeña

TÍTULO: Influencia del riesgo de interés sobre el mercado de renta variable

LUGAR: Facultad de Ciencias EE. y EE. de la Universidad de Valencia

Fecha: Septiembre 1999

Calificación: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad (**PREMIO EXTRAORDINARIO DE DOCTORADO UNIVERSIDAD DE VALENCIA 2000**)

(5)

AUTOR: Pedro Gento Marhuenda

TITULO: Evaluación de modelos VaR alternativos. Propuesta de un modelo para carteras de renta fija

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de la Universidad de Castilla-La Mancha, Albacete

FECHA DE LA LECTURA: Abril 2001

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad.

(6)

AUTOR: Escribano Sotos, Francisco

TITULO: La gestión del riesgo de interés de activos de renta fija sujetos al riesgo de insolvencia

LUGAR: Facultad de Ciencias Sociales de la Universidad de Castilla-La Mancha, Cuenca.

FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 2001

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad

(7)

AUTOR: Martínez Serna, M^a Isabel

TITULO: El contenido informativo de la estructura temporal de los tipos de interés

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de Murcia

FECHA DE LA LECTURA: Julio 2002

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad

(8)

AUTOR: Francisco Jareño Cebrián (codirigida con Antonio Díaz Pérez)

TITULO: Riesgo de Interés e Inflación en el Mercado Bursátil Español

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Castilla-La Mancha.

FECHA DE LA LECTURA: 10 de noviembre de 2006

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad

(9)

AUTOR: María de la O González Pérez (codirigida con Antonio Díaz Pérez)

TITULO: Contrastación de estrategias de inmunización unifactoriales en el mercado español de deuda pública

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Castilla-La Mancha.

FECHA DE LA LECTURA: Diciembre 2007

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad. **Tesis con mención europea**

(10)

AUTOR: Raquel López García

TITULO: Construction and Analysis of Fixed-Income volatility Indices

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Castilla-La Mancha.

FECHA DE LA LECTURA: Febrero 2014

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad. **Tesis con mención europea (PREMIO EXTRAORDINARIO DE DOCTORADO UNIVERSIDAD DE CASTILLA-LA MANCHA 2015)**

(11)

AUTOR: Álvaro Montealegre Moyano (codirigida con Anna Rita Bacinello y Pietro Milossovich)

TITULO: Métodos numéricos para la valoración de derivados complejos

LUGAR: Facultad de Ciencias Jurídicas y Sociales de la Universidad de Castilla-La Mancha

FECHA DE LA LECTURA: Marzo 2014

CALIFICACIÓN: Sobresaliente. **Tesis con mención europea y mención de calidad**

(12)

AUTOR: Pilar Requena Cabezuelo

TITULO: Dinámica de la Mortalidad de la Población Española: Una Nueva Visión del Modelo de Lee-Carter

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas, Empresariales y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 2017

CALIFICACIÓN: Sobresaliente.

(13)

AUTOR: David Atance del Olmo

TITULO: Un nuevo modelo dinámico de mortalidad basado en la edad clave y uso de técnicas de remuestreo para su evaluación

LUGAR: Facultad de Ciencias Económicas Empresariales y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Febrero 2021

CALIFICACIÓN: Sobresaliente *cum laude* por unanimidad (**PREMIO EXTRAORDINARIO DE DOCTORADO UNIVERSIDAD DE ALCALÁ 2021**)

OTROS MÉRITOS

Premios y becas recibidas con posterioridad a la licenciatura:

- Premio Extraordinario de Licenciatura 1.984. Universidad de Valencia
- Beca posdoctoral de la Excma. Diputación Provincial de Valencia para estancias en el extranjero, 1.987-1998
- Premio FUNDACIÓN MAPFRE a la Mejor ponencia del XV Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics (2014)

Otros cursos de posgrado impartidos:

- Master en Entidades de Depósito.
Organizado por la Fundación Universidad-Empresa de Valencia-ADEIT.
(Cursos 1989-1994 y 1996-97)
- Master Bursátil y Financiero
Organizado por la Fundación de Estudios Bursátiles y Financieros (Cursos 1992-2010)
- Master en Economía Bancaria
Organizado por la Universidad de Alicante. (Cursos 1998-2004)
- Master en Análisis Financiero
Organizado por la Universidad Carlos III de Madrid. (Cursos 2000-2003)
- Master en Banca y Finanzas
Organizado por la Universidad de Alcalá (Curso 2002-2003)
- Master en Comercio Exterior
Organizado por la Universidad de Castilla-La Mancha. Responsable del Área de Medios de Pagos y Financiación del Comercio Internacional (Cursos 2001-2009)
- Master en Entidades de Crédito “Ciudad de Cuenca”
Organizado por la Universidad de Castilla-La Mancha (Cursos 2004-2007)
- Master Oficial en Finanzas
Organizado por la Universidad de Murcia (Cursos 2008-15;2016-2021)
- Master Oficial en Finanzas y Contabilidad
Organizado por la Universitat Jaume I de Castellón (Curso 2009-10)
- Master en Entidades de Crédito
Organizado por la Universidad de Castilla-La Mancha (Cursos 2011-2018)
- Master en Management y Gestión del Cambio
Organizado por la Universidad de Alcalá (2011-13)
- Master Universitario en Ciencias Actuariales y Financieras
Organizado por la Universidad de Alcalá (Cursos 2014-22)

Trabajos de investigación de tercer ciclo, tesis de licenciatura y tesis doctorales dirigidas

A) Trabajos de investigación obligatorios del programa de doctorado de Economía Financiera de la Universitat de València:

AUTOR: Torró i Enguix, Hipòlit
TITULO: "Cobertura amb Futurs sobre Index"
LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de Valencia.
FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 1.993.
CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad.

AUTOR: Ferrer Lapeña, Román
TITULO: "Incidencia del riesgo de interés sobre el mercado de renta variable"
LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de Valencia.
FECHA DE LA LECTURA: Enero 1.995
CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad.

AUTOR: Díaz Pérez
TITULO: "Valoración del riesgo de insolvencia en los mercados españoles de renta fija"
LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de Valencia.
FECHA DE LA LECTURA: Julio 1.996
CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad.

B) Trabajos de investigación obligatorios del programa de doctorado de la Universidad de Castilla-La Mancha.

AUTOR: Escribano Sotos, Francisco.
TITULO: "Interrelación entre el riesgo de interés y el riesgo de insolvencia"
LUGAR: Facultad de Ciencias Jurídico-Sociales de la U.C.L.M., Toledo
FECHA DE LA LECTURA: Mayo 1.996
CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad.

AUTORA: Gómez Cantos, Brígida.
TITULO: "Análisis del diferencial de tipos de interés entre las operaciones de permuta financiera y de Deuda Pública"
LUGAR: Facultad de Ciencias y empresariales de la U.C.L.M., Albacete.
FECHA DE LA LECTURA: Septiembre 1.997.
CALIFICACION: Sobresaliente por unanimidad.

AUTOR: Jareño Cebrián, Francisco.
TITULO: "Interrelación entre el mercado de renta variable y los tipos de interés: estudio del coeficiente de absorción de la inflación de las empresas españolas"
LUGAR: Facultad de Ciencias y Empresariales de la U.C.L.M., Albacete.
FECHA DE LA LECTURA: Noviembre 2002.
CALIFICACION: Sobresaliente por unanimidad.

AUTOR: María de la O. González Pérez
TITULO: Contratación de las estrategias de inmunización financiera en el mercado español
LUGAR: Facultad de Ciencias y Empresariales de la U.C.L.M., Albacete.
FECHA DE LA LECTURA: Mayo de 2003.
CALIFICACION: Sobresaliente por unanimidad

AUTOR: Juan José Pérez García Catalán
TITULO: Convergencia en la Unión europea de los Nuevos Estados Miembros de Europa Central y del Este
LUGAR: Facultad de Ciencias y Empresariales de la U.C.L.M., Albacete.
FECHA DE LA LECTURA: Octubre 2005
CALIFICACION: Sobresaliente (10) por unanimidad

AUTOR: Raquel López García
TITULO: Construcción de un índice de volatilidad implícita de tipos de interés. Metodología y evidencia empírica
LUGAR: Facultad de Ciencias y Empresariales de la U.C.L.M., Albacete.
FECHA DE LA LECTURA: Mayo 2008
CALIFICACION: Sobresaliente (10) por unanimidad

C) Trabajos de investigación obligatorios del programa de doctorado en Finanzas Cuantitativas de la Universidad de Valencia, Universidad del País Vasco y Universidad Complutense de Madrid.

AUTOR: Silla Sancho, Estanislao
TITULO: LIBOR Market Model. Una aproximación al paradigma lognormal en la valoración de derivados sobre tipos de interés.
LUGAR: Facultad de Economía de la Universidad de Valencia
FECHA DE LA LECTURA: Julio 2003

AUTOR: Navarro Girbés, Lluís
TITULO: Métodos numéricos para la valoración de derivados sobre tipos de interés
LUGAR: Facultad de Economía de la Universidad de Valencia
FECHA DE LA LECTURA: Julio 2003

AUTOR: Márquez Monterrubio, Susana
TITULO: Las diferencias en las expectativas de crecimiento del consumo en la zona euro
LUGAR: Facultad de Economía de la Universidad de Valencia
FECHA DE LA LECTURA: Junio 2007

AUTOR: Alvaro Montealegre
TITULO: Estimación de tipos cupón cero y estructura temporal de volatilidades. Impacto en la valoración de derivados sobre tipos de interés.
LUGAR: Facultad de Ciencias Jurídicas y Sociales de la UCLM. Toledo
FECHA DE LA LECTURA: Julio 2009

AUTOR: Ryan Monkerud

TITULO: Estudio de la Influencia de los Prepagos Exógenos sobre el Cupón Incremental de una Hipoteca

LUGAR: Facultad de Ciencias Jurídicas y Sociales de la UCLM. Toledo

FECHA DE LA LECTURA: Julio 2009

D) Trabajos de investigación obligatorios del programa de doctorado en otras universidades

AUTOR: Juan Carlos Bencomo Armas

TITULO: Estructura temporal de los tipos de interés. Aspectos teóricos y evidencia empírica

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. De la Universitat Jaume I de Castellón

FECHA DE LA LECTURA: Febrero 2011

CALIFICACIÓN: Sobresaliente

E) Tesis de Licenciatura:

AUTOR: Nave Pineda, Juan Miguel

TITULO: Estrategias de Inmunización Dinámica

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de Valencia

FECHA DE LA LECTURA: Mayo 1.994

CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad.

AUTOR: M^a Isabel Martínez Serna

TÍTULO: La estructura temporal de los tipos de interés y la política monetaria, Contraste del modelo de McCallum

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. de la Universidad de Murcia

FECHA DE LA LECTURA: Septiembre de 1999

CALIFICACIÓN: Sobresaliente por unanimidad

F) Trabajos Fin de Master en Master U. en Ciencias Actuariales y Financieras de la Universidad de Alcalá

AUTOR: Beatriz Royo García

TÍTULO:

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Junio 2015

AUTOR: David Atance del Olmo

TÍTULO: Análisis Unifactorial de la Tasa de Mortalidad

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Junio 2015

AUTOR: Marco Vinci

TÍTULO: “Act of God”: Cómo los aseguradores se protegen frente a los riesgos catastróficos

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Junio 2016

AUTOR: Eliseo Mateo Jiménez

TITULO: Bonos Indexados a la Inflación: Sensibilidad de los activos financieros ante los tipos de interés reales

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Octubre 2017

AUTOR: Marcos Espeja Leal

TITULO: Proyección de la población española 2017-2055

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: Octubre 2017

AUTOR: Sergio Rodríguez Brito

TITULO: Bonos Indexados a la Inflación: Estimación de su Valor y Duración Emprírica

LUGAR: Facultad de CC. EE. y EE. y Turismo de la Universidad de Alcalá

FECHA DE LA LECTURA: julio 2020

Otros cargos académicos y actividades científicas

Puestos de gestión académica

- Miembro del Claustro de la Universidad de Alcalá (desde 5 de abril de 2016 hasta enero 2020)
- Director del Departamento de Economía y Dirección de Empresas de la Universidad de Alcalá desde 28 de febrero de 2013 hasta 27 de abril de 2016)
- Director en funciones del Departamento de Economía y Dirección de Empresas de la Universidad de Alcalá (desde 1 de noviembre de 2012 hasta el 27 de febrero de 2013))
- Director del Departamento de Ciencias Empresariales de la Universidad de Alcalá (desde 20 de enero de 2012 hasta 31 de octubre de 2012).
- Vicedecano de Relaciones Institucionales de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales de la Universidad de Castilla-La Mancha desde 25 de Marzo de 1997 hasta julio 1999
- Subdirector del Departamento de Economía y Empresa de la Universidad de Castilla-La Mancha desde 23 de febrero de 1.995 hasta 20 de febrero de 1.996.
- Miembro de la Junta de Gobierno de Castilla-La Mancha desde diciembre de 1.995 diciembre 1999.
- Miembro del Claustro de la Universidad de Castilla-La Mancha desde 14 de marzo de 1.995 hasta diciembre 1999.

Puestos de gestión docente

- Profesor responsable por la UCLM en el Master Oficial Interuniversitario en Banca y Finanzas Cuantitativas (con la Universidad de Valencia, Universidad del País Vasco y Universidad Complutense de Madrid). Cursos 2006/07 y 2007/08
- Director del Master Universitario en Ciencias Actuariales y Financieras de la Universidad de Alcalá (I-II-III-IV-V Edición: 2013-18 y IX-X edición 2021-23)
- Director del Master en Entidades de Crédito de la Universidad de Castilla-La Mancha (I-II-III-IV-V-VI-VII-VIII-IX-X-XI-XII-XIII-XIV-XV Edición 1996-2011)
- Co-director del Master en Entidades de Crédito “Ciudad de Cuenca” (I –II-III edición 2004-07).
- Presidente de la Comisión de Expertos Externos para la evaluación de la Titulación de Investigación y Técnicas de Mercado de la Universidad de Sevilla en el marco del Plan Nacional de Evaluación Institucional de la Calidad de las Universidades.
- Director del Área de Economía y Empresa del Instituto de Desarrollo Regional desde 1 de octubre de 1.995 hasta 1 de julio de 2001.
- Profesor Responsable del programa de Doctorado de Economía Financiera (115-B) de la Universitat de València durante los cursos 1991-92; 1.992-93 y 1.993-94.
- Co-Director del Master en Dirección y Gestión de los Sistemas de Seguridad Social de la Universidad de Alcalá y la Organización Iberoamericana de la Seguridad Social (2011-12; 2012-13; 2013-14, 2014-15 y 2015-16-2016-17; 2017-18;2018-19;2019-20;2020-21;2021-22)

Otros

- Miembro de la Junta Directiva de la Asociación Española de Finanzas (AEFIN) desde noviembre 2.005 hasta noviembre de 2007
- Miembro de tribunales de tesis doctorales:

<u>Doctorando</u>	<u>Universidad</u>	<u>Año</u>
1. Ángeles Fernández Izquierdo	U. Valencia	1991
2. Monserrat Rué i Monné	U. Barcelona	1992
3. Gonzalo Lozano Arnica	U. Illes Balears	1992
4. M. Teresa Preixens Benedicto	U. Barcelona	1992
5. Cristina Tomás i Pérez	U. Barcelona	1993
6. Sandra Moroni Marrero	U. La Laguna	1995
7. Joseba Iñaki de la Peña Esteban	U. País Vasco	1996
8. Marco Leber	U. Autónoma Madrid	1996
9. Miguel Ángel Martínez Sedano	U. País Vasco	1996
10. Francesc Llerena Garrés	U. Rovira i Virgili	1996

11. Alfredo Ibáñez	U. Carlos III	1997
12. Paz Rico Belda	U. Valencia	1997
13. Julio Lucia López	U. Valencia	1997
14. Jorge Belaire Franch	U. Valencia	1998
15. Inmaculada Gómez Fernández	U. Huelva	1998
16. Matías Gámez Gómez	U. Castilla-La Mancha	1998
17. Ángel León Valle	U. Alicante	1998
18. Enrique Pociello García	U. Barcelona	2000
19. Bartolomé Pascual Fuster	U. Illes Balears	2000
20. Pilar Abad Romero	U. Complutense	2000
21. Rosa Puertas Medina	U. Valencia	2000
22. Gloria M. Soto Pacheco	U. Murcia	2001
23. Pedro Luis Contreras Melgares	U. N. E. D.	2001
24. Rosa Badillo Amador	U. Valencia	2002
25. Magdalena Massot Perelló	U. Illes Balears	2003
26. Jesús David Moreno Muñoz	U. Alcalá	2003
27. José A. de Luca Martínez	U. Murcia	2004
28. M. Lourdes Gómez del Valle	U. Valladolid	2004
29. Eva Roperó Morriones	U. Carlos III	2006
30. Almudena García Pérez	U. Alcalá	2007
31. Anna Downarowicz	U. Carlos III	2007
32. Marc Carrera Pijuan	U. Barcelona	2007
33. Helena Chuliá Soler	U. Valencia	2007
34. Javier Población García	U. Castilla-La Mancha	2009
35. Juan Miguel Londoño	U. País Vasco	2009
36. Jordi Andreu Corbatón	U. Barcelona	2009
37. Marta Tolentino García-Abadillo	U. Castilla-La Mancha	2009
38. Laura Ballester Miquel	U. Valencia	2010
39. Jacinto Marabel Romo	U. Alcalá	2011
40. Adrián Fernández Pérez	U. Las Palmas	2012
41. Luis Maldonado García-Pertierra	U. Alcalá	2013
42. Raúl del Pozo Rubio	U. Castilla-La Mancha	2013
43. Javier García Mirantes	U. Castilla-La Mancha	2013
44. Manuel Ventura Marco	U. Valencia	2015
45. José Alfredo Jiménez Moscoso	U. Valencia	2015
46. Célia Patricio Valente de Oliveira	U. Extremadura	2015
47. Yao Peng	U. Carlos III	2015
48. Olivia Peraita Ezcurra	U. Complutense	2015
49. Juan Manuel Pérez-Salamero	U. de Valencia	2015
50. Raül Martínez Buixeda	U. de Barcelona	2016
51. Iván Blanco	U. Carlos III	2016
52. Irene M. Pereira da Guia Arraiano	U. Extremadura	2016
53. Andrés Benchimol	U. Carlos III	2016
54. Alfonso Sáez Alonso-Muñumer	U. Pontificia Comillas	2017
55. Josep Lledó Benito	U. València	2017
56. Karin Martín Bujack	U. Pontificia Comillas	2017
57. M ^a Angeles del Pino Álvarez	U. Almería	2018

58. Javier Carlos Sanjurjo Trigueros	U. Alcalá	2019
59. Rodrigo Ferreras Labra	U. Complutense	2020
60. Eduardo Ramos Fernández	U. Alcalá	2022

· Coordinador y Director del nº 70 de la Revista Análisis Financiero. Volumen sobre "El Riesgo de Interés"

· Supervisor del libro: "La Gestión del Riesgo de Interés y de Mercado. Nuevas Técnicas de Valoración. Ed. Fundación BBV. Bilbao 1998

· Evaluador en diferentes ediciones de los siguientes Congresos:

- Foro de Finanzas
- *Symposium* de Análisis Económico
- European Financial Association
- Congreso Hispano-Italiano de Matemáticas Financieras

· Evaluador al menos en una ocasión de las siguientes revistas científicas:

- Revista de Economía Aplicada
- Revista Española de Financiación y Contabilidad
- Documentos de Trabajo del Instituto Valenciano de Investigaciones Económicas
- Investigaciones Económicas
- Moneda y Crédito
- *European Journal of Finance*
- *Spanish Economic Review*
- Revista Europea de Administración y Economía de la Empresa
- *European Journal of Operational Research*
- Estudios de Economía Aplicada
- *Journal of Banking and Finance*
- *International Review of Economics and Finance*
- *Decisions in Economics and Finance*
- *Annals of Operations Research*
- *Global Policy*
- *European Journal of Management and Business Economics*
- *Technological and Economic Development of Economy*

· Evaluador de proyectos de investigación para:

- Agencia Nacional de Evaluación y Prospectiva. Ministerio de Ciencia y Tecnología. Convocatorias 2001; 2002; 2003; 2004; 2005; 2006; 2007; 2008; 2009; 2010; 2017
- Fundación Ramón Areces. Concurso de ayudas a la investigación en Economía. Convocatoria 2001.
- Comité de Selección de la 3ª edición de las Ayudas AECA a la Investigación.(2004)
- Agencia para la Calidad del Sistema Universitario de Castilla y León. (2009)
- Agencia Nacional de Evaluación y Prospectiva. Evaluador de memorias para Becas FPU . Convocatoria 2012

- Miembro del comité para la evaluación de proyectos de investigación multidisciplinares de la Universidad Autónoma de Madrid, 2013
- Colaborador Técnico en calidad de Evaluador en materia de Área I+D+i para la Dirección de Evaluación y Acreditación de la Agencia Andaluza del Conocimiento (DEVA-AAC) 2021-2023

- Vocal Suplente de la Comisión de Acreditación para el acceso al Cuerpo de Profesores Titulares de Universidad, en la rama de Ciencias Sociales y Jurídicas (Programa ACADEMIA de la ANECA). Septiembre de 2013 hasta febrero de 2014.

- Miembro Titular de la Comisión de Acreditación nacional para el Cuerpo de Profesores Titulares de Universidad desde 4 de febrero de 2014 hasta febrero de 2017 (Programa ACADEMIA de la ANECA)

- Presidente de la Comisión de Revisión de Ciencias Sociales y Jurídicas del Programa ACADEMIA de la ANECA desde 4 de diciembre de 2017 a 4 diciembre 2021

- Miembro del Consejo Editorial de las siguientes revistas científicas
 - Revista Española de Financiación y Contabilidad (2002-07)
 - Revista de Economía Financiera (2003-05)

- Miembro del comité científico de:
 - Congreso Hispano-Italiano de Matemáticas Financieras. Varias ediciones
 - Foro de Finanzas. Varias ediciones
 - *International Conference of Mathematical and Statistical Method for Actuarial Sciences and Finance (MAF 2010,2011,2012,2013,2018,2022)* Univesitá di Salerno y Univesitá di Venecia. Varias ediciones

- Miembro de Asociaciones profesionales/científicas:
 - Asociación Española de Finanzas (AEFIN)
 - Instituto Español de Analistas Financieros
 - Asociación Española de Contabilidad y Administración de Empresas (AECA)
 - Vocal de la Comisión directiva de la Asociación Española de finanzas 2006-2007-2008

- Co-organizador de las *Jornadas sobre Estructura Temporal de los tipos de interés*: I - II ediciones (Instituto Complutense de Análisis Económico de Madrid, 2000-2001) – III-IV-V ediciones (UCLM , Cuenca, 2002-2003-2004)

- Presidente del Comité Organizador del VII Congreso Hispano-Italiano de Matemáticas Financieras y Actuariales. Cuenca 8 y 9 de julio de 2004

- Co-Presidente del Comité Científico del XIV Foro de Finanzas. Universitat Jaume I. Castellón 16-17 de noviembre de 2006

- **Otras (divulgación)**
 Colaborador del diario El Pueblo de Albacete (artículo semanal en suplemento de Economía, La Cuerda) desde octubre de 2010 hasta octubre 2011