

CURRICULUM VITAE

Ricardo Gimeno Nogués Date of Birth: April 19th, 1973
Research Department Telephone:
Banco de España Fax:
Alcalá 48 E-mail: ricardo.gimeno@bde.es
Madrid 28014 (Spain)



EDUCATION AND EXPERIENCE:

- 2005-present Economist
Banco de España
- 2005-present Visiting Professor of Financial Econometrics
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).
- 2002-2005 Associate Professor of Econometrics and Financial Mathematics.
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).
- Summer 2003 Visiting fellow.
International Center for Finance, School of Management, Yale University.
- 2000-2002 Assistant Professor of Econometrics and Financial Mathematics.
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).
- 1996-2000 Ph.D. in Business Administration. Area of Concentration: Finance.
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).
Fellowship awarded by Department of Quantitative Methods.
Dissertation: *Chaos Analysis of High Frequency Financial Time Series. The Spanish 10-year Notional Bond Future Contract.*
Supervisor: Prof. Eduardo Morales.
- 1995-1996 Fellowship awarded by Department of Quantitative Methods.
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).
- 1991-1996 BSc. in Business Administration (major: Finance).
Universidad Pontificia Comillas de Madrid (ICADE).

LAST PUBLICATIONS:

- Sáenz Díez, R., R. Gimeno, and C. Abajo (2007), "Simulation and risk adjustment on a real options valuation model: A case study of an e-commerce company", *Journal of Applied Corporate Finance (Forthcoming)*.
- Olmedo, E., R. Gimeno, L. Escot and R. Mateos (2007), "Convergencia y estabilidad de los tipos de cambio europeos: Una aplicación de exponentes de Lyapunov", *Cuadernos de Economía*, vol. 44, pp. 91-108.
- Gimeno, R. and J. Nave, (2006), "Genetic Algorithm Estimation of the Interest Rate Term Structure", Working paper Banco de España N°.0634.
- González, C. I. and Gimeno, R. (2006), "Evaluación de las metodologías para medir el Valor en Riesgo", *Estabilidad Financiera*, vol. 11, pp. 45-59.
- Gimeno, R. and Martínez-Carrascal, C. (2006), "The interaction between housing prices and loans for house purchase", Working paper del Banco de España N° 0605.
- Mateos de Cabo R., Escot, L. y Gimeno, R. (2006), "Análisis de la Presencia de la Mujer en los Consejos de Administración de las Mil Mayores Empresas Españolas", Working paper *FUNCAS* N° 263.

PH.D. SUPERVISOR:

- Ester Martín-Caro (Universidad Pontificia Comillas - ICADE), June 2006. Awarded by the Business Administration School to the best dissertation of 2006.
- Carlos Casas (Universidad CEU San Pablo), December 2007.

REFEREE:

- Physica A, Economía Aplicada, Applied Intelligence, Computacional Economics.

PH.D. COMITEES:

- Elena Olmedo Fernández (Universidad de Sevilla), October 2001.
Inés Portillo (Universidad Complutense de Madrid), September 2003.
Rocio Sáenz-Díez Rojas (Universidad Pontificia Comillas - ICADE), June 2004.
David Quintana Montero (Universidad Pontificia Comillas - ICADE), September 2004.
José Ramón Sánchez Galán (Universidad Complutense de Madrid), December 2006.
Carmen García Centeno (Universidad CEU San Pablo), October 2007.

LECTURES:

CEMFI, Hebrew University of Jerusalem, Bank of England, MEFF, Université Catholique de Louvain, Universidad Cardenal Herrera –CEU, Universidad Rey Juan Carlos.

OTHER PUBLICATIONS:

- Gimeno, R. y Martínez-Carrascal, C. (2006), “La interacción entre el precio de la vivienda y el crédito a hogares”, *Boletín Económico*, Marzo 2006, pp. 62-69.
- Gimeno, R. and R. Mateos (2006), “Statistics and finance: Living on the ‘hedge’”, in *Teaching Statistics*.
- Quintana, D., R. Gimeno and P. Isasi (2006), “Detección de inercia sectorial en salidas a bolsa mediante modelos ARIMA y redes neuronales”, *Economía & Administración*,
- Mateos, R., R. Gimeno, M. Martínez, D. Quintana, L. López, A. Mielgo, P. Saá and M. Saco (2006), *Presencia de estereotipos en los medios de comunicación: análisis de la prensa digital española*, Comunidad de Madrid, Consejería de Empleo y Mujer.
- Olmedo, E., J.M. Valderas, R. Gimeno and L. Escot (2005), “Nonlinear Forecasting in Economics: a Comparison Between Comprehension Approach Versus Learning Approach. An Application to Spanish Time Series”, *FUNCAS working paper* n. 2042005.
- Mateos, R. and R. Gimeno (2004), “Evaluación del proyecto de Madrid 2012 bajo un enfoque de mercado. Una exploración de posibilidades y mejoras”, *Cuadernos de Gestión*, vol. 4, pp. 97-118.
- Gimeno, R., P. Grau, L. Escot, R. Mateos and E. Olmedo, (2004), “Detección de comportamientos caóticos en series de coyuntura económica española utilizando modelos TAR”, *Análisis de Coyuntura*, vol. 10, pp. 123-142.
- Olmedo, E., J. M. Valderas, R. Mateos, and R. Gimeno (2004), “Utilización de Redes Neuronales en la Caracterización, Modelización y Predicción de Seres Temporales Económicas en un Entorno Complejo”, *Inteligencia Artificial*, vol. 8, pp. 7-25.
- Gimeno, R., P. Grau, L. Escot, R. Mateos and E. Olmedo (2003), “Consecuencias para la predicción de la existencia de caos utilizando modelos TAR”, Universidad Complutense de Madrid working paper 2003-10.
- Gimeno, R. and E. Morales, (2003), “Modelos de volatilidad del futuro sobre el bono nocial a 10 años”, *Seminario de Matemática Financiera MEFF-UAM*, vol. 5.
- Gimeno, R., (2001), “Análisis caótico de series temporales financieras”, *ICADE* (2001), vol. 52, pp. 335-341.
- Gimeno, R., B. Manchado and R. Mínguez, (1999), “Stationarity Tests for Financial Time Series”, *Physica A*, vol. 269, pp. 72-78.
- Peralta Astudillo, M.J., C. Lozano Colomer, E. Jiménez Pulmariño, R. Gimeno and S. Carabias López, (1999), “Evolución del tratamiento matemático de los problemas dinámicos a lo largo del siglo XX”, *ICADE*, vol. 47, pp. 13-35.
- Ricardo Gimeno and Jose Manuel Rodriguez Carrasco (1998), “El pensamiento estratégico de Michael Porter”, in Jose Manuel Rodriguez Carrasco ed. (1998), *Fundamentos de Dirección Estratégica*, Ed. Pirámide, Madrid. pp. 47-69. and in Jose Manuel Rodriguez Carrasco ed. (2003), *Estrategia y Política de Empresas*, Ed. Pirámide, Madrid. pp. 47-69.

NON-REGULAR EDUCATION:

Sort-term courses at: Bank of Austria, Bank of England, Bundesbank, Harvard University, Universitat Pompeu-Fabra, Universidad Carlos III, Universidad de Alcalá de Henares, Universidad Complutense de Madrid, Université Catholique de Lille, among others.