

Parte A. DATOS PERSONALES

Fecha del CVA	15/04/2021
----------------------	------------

Nombre y apellidos	Susan Orbe Mandaluniz		
Núm. identificación del investigador	Researcher ID		
	Código Orcid	0000-0002-5638-0036	

A.1. Situación profesional actual

Organismo	Universidad del País Vasco/Euskal Herriko Unibertsitatea		
Dpto./Centro	Métodos Cuantitativos		
Dirección	Av. Lehendakari Aguirre 83		
Teléfono	94 601 3845	correo electrónico	Susan.orbe@ehu.eus
Categoría profesional	Titular de universidad	Fecha inicio	26/10/2002
Espec. cód. UNESCO	5302 Econometría		
Palabras clave	Estimación semiparamétrica, coeficientes cambiantes, contrastes		

A.2. Formación académica (título, institución, fecha)

Licenciatura/Grado/Doctorado	Universidad	Año
Doctora	UPV/EHU	2000

Parte C. MÉRITOS MÁS RELEVANTES (ordenados por tipología)

C.1. Publicaciones

Jone Ascorbebeitia, Eva Ferreira y Susan Orbe. Time-varying coefficient estimation in SURE models. Application to portfolio management. Journal of Business & Economic Statistics
<https://doi.org/10.1080/07350015.2021.1883439>

Isabel Casas; Eva Ferreira y Susan Orbe. Time-varying coefficient estimation in SURE models. Application to portfolio management. Financial Econometrics
<https://doi.org/10.1093/jfinec/nbz010>

Casilda Lasso de la Vega, A Lekuona, y S Orbe. Re-examining the inequality of opportunity in education in some European countries. Applied Economics Letters, 27, 544—548. 2020

Ferreira García y Orbe Mandaluniz, Susan. Why are there time-varying comovements in the European stock market? European Journal of Finance, 24, 828—848. 2018

M. Victoria Esteban, Ferreira García y Orbe Mandaluniz, Susan. Nonparametric methods for estimating and testing for constant betas in asset pricing models. Applied Economics, 47, 2577—2607. 2015

Zarraga Alonso, Ainhoa; Orbe Mandaluniz, Susan y Belén Nieto Domenech. Time-varying market beta: does the estimation methodology matter? Statistics and Operations Research Transactions (SORT), 38, 13—42. 2014

Ferreira García, Eva; Gil-Bazo, Javier y Orbe Mandaluniz, Susan. Conditional beta pricing models: A nonparametric approach. Journal of Banking and Finance, 35, 3362--3382. 2011

Arteche González, Jesús María; Majovská, Renata; Mariel Chladkova, Petr; Orbe Mandaluniz, Susan. Detection and Correction of the pre-Easter and Easter Effect. Ekonomicky Casopis, 59, 472—487. 2011

Esteban González, María Victoria y Orbe Mandaluniz, Susan. A nonparametric approach for estimating betas: The smoothed rolling estimator. Applied Economics, 42, 1269—1279. 2010

Mariel Chladkova, Petr y Orbe Mandaluniz, Susan. Nonparametric Approach to Patent Citations. Prague Economic Papers, 18, 251—266. 2009

Mariel Chladkova, Petr; Orbe Mandaluniz, Susan y Rodríguez González, Carlos. The Knowledge-Capital Model of Fdi: A Time Varying Coefficients Approach. Scottish Journal of Political Economy, 56, 196—212. 2009

Orbe Mandaluniz, Susan; Ferreira García, Eva y Rodríguez Póo, Juan Manuel. On the estimation and testing of time varying constraints in econometric models. Statistica Sinica, 16, 1313—1333. 2006

Mariel Chladkova, Petr y Orbe Mandaluniz, Susan. Nonparametric estimation of the effects of advertising: The case of Lydia Pinkham. Journal of Business, 78, 649—673. 2005

Orbe Mandaluniz, Susan; Ferreira García, Eva y Rodríguez Póo, Juan Manuel. Nonparametric estimation of time varying parameters under shape restrictions. Journal of Econometrics, 126,53--77. 2005

Orbe Mandaluniz, Susan; Ferreira García, Eva y Rodríguez Póo, Juan Manuel. An algorithm to estimate time varying parameter SURE models under different type of restrictions Computational Statistics and Data Analysis, 42, 363—383. 2002

Orbe Mandaluniz, Susan; Ferreira García, Eva y Rodríguez Póo, Juan Manuel. A nonparametric method to estimate time varying coefficients under seasonal constraints Journal of Nonparametric Statistics, 12, 779—806. 2000

C.2. Proyectos

Mercados y Evaluación de Políticas". PID2019-108718GB-I00. Ministerio de Economía y Competitividad-MINECO. IP: Aitor Ciarreta. 1-06-2020 a 31-05-2023.

BiRTE, (Bilbao Research Team in Economics). IT1336-19. Gobierno Vasco. IP: Aitor Ciarreta. 1-01-2019 a 31-12-2021.

Consolidación de la Red Biostatnet: Nuevas Estrategias de Colaboración en Investigación, Transferencia y Formación. Ministerio de Economía y Competitividad. IP: Cadarso Suárez, Carmen. 01/06/2012 a31/05/2014

MACLAB. Gobierno Vasco. IP: Vázquez Pérez, Jesús. 01/01/2013 a 31/12/2018.

BILBAO ECONOMIC THEORY AND STATISTIC. UPV/EHU. IP: Ferreira García, María Eva. 01/11/2011 a 31/12/2014.

Estimación de modelos beta y estrategias de gestión de carteras en contextos cambiantes en el tiempo. Ministerio de Ciencia e Innovación. IP: Ferreira García, María Eva 01/01/2012 a 31/12/2014.

Formación de una Red Nacional de Bioestadística. Ministerio de Ciencia e Innovación IP: Cadarso Suárez, Carmen. 15/11/2010 a 14/11/2012.

Métodos Cuantitativos en Economía Financiera. Ministerio de Ciencia e Innovación UPV/EHU. IP: Ferreira García, María Eva. 01/01/2009 a 31/12/2011

Demografía y mercado de trabajo, recursos naturales y medio ambiente y macroeconomía y finanzas. Gobierno Vasco. IP: de la Rica Goiricelaya, Sara. 01/01/2007 a 31/12/2012

Jornadas de Exploración de Matemática Aplicada a las Decisiones en Finanzas. Proyecto Consolider Ingenio Mathematica (i-MATH) del Ministerio de Educación y Ciencia IP: Garín Martín, María Araceli. 15/04/2007 a 31/12/2007

Análisis de la integración de los mercados de renta fija en la Unión Europea. Ministerio de Educación y Ciencia. IP: Ferreira García, María Eva. 31/12/2005 a 31/12/2008

Integración y Eficiencia de los mercados de renta fija en los países de la Unión Europea
Fundación BBVA. IP: Ferreira García, María Eva. 23/05/2005 a 23/06/2007

Grupo Consolidado 9/UPV-00038.321-15094/2001. UPV/EHU. IP: Tusell Palmer, Fernando Jorge. 04/10/2001 a 31/12/2006.

Análisis estadísticos multivariantes. Gobierno Vasco-Universidad del País Vasco. IP: Tusell Palmer, Fernando Jorge. 04/10/2001 a 31/12/2006.

Valoración, liquidez, gestión institucional y tipos de interés. Ministerio de Ciencia y Tecnología. IP: Rubio Irigoyen, Gonzalo. 28/12/2001 a 27/12/2004.

Métodos Cuantitativos Aplicados al Estudio de los Mercados Financieros. UPV/EHU. P: Ferreira García, María Eva. 01/10/1999 a 30/09/2001.

Nuevas metodologías en Estadística: Datos longitudinales, estimación semiparamétrica, aplicaciones a datos financieros e inserción de encuestas. Ministerio de Educación y Cultura
IP: Núñez Antón, Vicente Alfredo .30/12/1999 a 29/12/2002.