

# Currículum Vitae – Pedro José Serrano Jiménez

## Parte A. DATOS PERSONALES Y PROFESIONALES

Nombre y apellidos	Pedro José Serrano Jiménez		
DNI/NIE/pasaporte	48466661A	Edad	39
Universidad Carlos III de Madrid (UC3M) – Departamento de Economía de la Empresa			
C/ Madrid, 126 – 28903 Getafe (Madrid)			
Dirección web: <a href="https://sites.google.com/site/pjserran/">https://sites.google.com/site/pjserran/</a>			
Email: <a href="mailto:pedrojose.serrano@uc3m.es">pedrojose.serrano@uc3m.es</a>			
Áreas de interés: Deuda soberana, riesgo de liquidez, riesgo de crédito, valoración de activos, finanzas cuantitativas			

### A.1. Situación profesional

Categoría profesional	Departamento	Universidad	Fecha inicio	Fecha fin
Profesor visitante (Tenured)	Economía de la Empresa	UC3M	01/02/2014	Actualidad
Profesor Visitante (Tenure track)	Economía de la Empresa	UC3M	01/02/2008	31/01/2014

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

Documento	Licenciatura/Grado/Doctorado	Universidad	Año
[1]	Doctor en Finanzas Cuantitativas	Universidad del País Vasco	2008
[2]	Diploma Estudios Avanzados en Finanzas Cuantitativas	Universidad de Valencia	2004
[3]	Licenciado en Ciencias Físicas	Universidad de Valencia	2002

### A.3. Evaluaciones

[1] Dispone de la acreditación para el cuerpo de Profesores Titulares de Universidad (Referencia 2018-000134 P, 18 de julio de 2018).

**Nota:** Se acompaña con un asterisco [\*] aquella documentación que no se haya podido aportar físicamente por ausencia de respuesta administrativa, omisión o extravío, entre otras circunstancias. Con objeto de minimizar esta situación, se incluye la máxima información posible para contrastar su veracidad.

## Parte B. MÉRITOS DE INVESTIGACIÓN

### B.1. Publicaciones

**Nota:** el orden de los autores en el artículo es alfabético, según es costumbre en las revistas del área. Este orden no refleja el grado de contribución al artículo.

#### Indexadas en el JCR

[1] Juan Ángel Lafuente, Nuria Petit y Pedro Serrano, *en prensa*, “Pricing factors in the multiple-term structures from interbank rates,” *Journal of International Money and Finance*. Tercil (JCR2017 - último disponible): 2; Cuartil (JCR2017): 2. Posición: 34/98 (JCR2017).

[2] Federico Platania, Pedro Serrano y Mikel Tapia, 2018, “Modelling the shape of the limit order book,” *Quantitative Finance*, Volumen 18, No. 9, pp. 1575–1597. Tercil (JCR2017 - último disponible): 2; Cuartil (JCR2017): 3. Posición: 55/98 (JCR2017).

[3] Juan Ángel Lafuente, Nuria Petit y Pedro Serrano, 2018, “Forecasting multiple-term structures from interbank rates,” *International Review of Financial Analysis*, Volumen 57, pp. 40-56. Tercil (JCR2017- último disponible): 2; Cuartil (JCR2017): 2. Posición: 38/98 (JCR2017).

[4] Antonio Rubia, Lidia Sanchís-Marco y Pedro Serrano, 2016, “Market illiquidity and pricing errors in the term structure of CDS spreads,” *Journal of International Money and Finance*, Volumen 60, pp. 223-252. Tercil (JCR2016): 1; Cuartil (JCR2016): 1. Posición: 21/96 (JCR2016).

[5] Armen Arakelyan, Gonzalo Rubio y Pedro Serrano, 2015, “The reward for trading illiquid maturities in credit default swap markets,” *International Review of Economics and Finance*, Volumen 39, pp. 376–389. Tercil (JCR2015): 1; Cuartil (JCR2015): 1. Posición: 17/94 (JCR2015).

[6] Antonio Díaz, Jonatan Groba y Pedro Serrano, 2013, “What drives corporate default risk premium? Evidence from the CDS markets,” *Journal of International Money and Finance*, Volumen 37, pp. 529–563. Tercil (JCR2013): 2; Cuartil (JCR2013): 2. Posición: 33/91 (JCR2013).

[7] Jonatan Groba, Juan Ángel Lafuente y Pedro Serrano, 2013, “The impact of distressed economies on the EU sovereign market,” *Journal of Banking and Finance*, Volumen 37, pp. 2520–2532. Tercil (JCR2013): 1; Cuartil (JCR2013): 1. Posición: 22/91 (JCR2013).

[8] Manuel Moreno, Pedro Serrano y Winfried Stute, 2011, “Statistical properties and economic implications of jump-diffusion processes with shot-noise effects,” *European Journal of Operational Research*, Volumen 214 pp. 656–664. Tercil (JCR2011): 1; Cuartil (JCR2011): 1. Posición: 6/77 (JCR2011). Nota: Artículo en el 1er decil del JCR.

#### No indexadas en el JCR con indicadores de calidad

[9] Armen Arakelyan y Pedro Serrano, 2016, “Liquidity in Credit Default Swap Markets,” *Journal of Multinational Financial Management*, Volúmenes 37–38, pp.139-157. SCImago Journal Rank 2016: Q2 (Finance), Q3 (Economics & Econometrics).

[10] Juan Ángel Lafuente y Pedro Serrano, 2015, “On the compensation for illiquidity in sovereign credit markets,” *Journal of Multinational Financial Management*, Volumen 30, pp. 83–100. SCImago Journal Rank 2015: Q3 (Finance), Q3 (Economics & Econometrics).

## Capítulos de libro

[11] Antton Barandiarán, Manuel Moreno y Pedro Serrano, 2009, "Monte Carlo Valuation of CDOs under a Reduced Form Approach," capítulo en *New Frontiers in Insurance and Bank Risk Management*, pp.133-148, editado por C. Angela, S. Carrillo Menéndez, M. Micocci, E. Navarro Arribas, R. Ottaviani, F. Pressacco. Milano: McGraw-Hill.

[12] Manuel Moreno, Juan Ignacio Peña y Pedro Serrano, 2008, "Pricing Tranched Credit Products with Generalized Multifactor Models," capítulo en *Credit Risk Models, Derivatives and Management Financial Mathematics Series*, pp. 485-510, editado por Niklas Wagner. Boca Raton: Chapman & Hall.

[13] Manuel Moreno y Pedro Serrano, 2008, "Numerical Pricing of Collateral Debt Obligations: A Monte Carlo Approach," capítulo en *Credit Risk Models, Derivatives and Management Financial Mathematics Series*, pp. 527-549, editado por Niklas Wagner. Boca Raton: Chapman & Hall.

## Artículos en evaluación y pendientes de envío

[14] Juan Ángel Lafuente, Nuria Petit, Jesús Ruiz y Pedro Serrano, "Dissecting interbank risk" ([https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=2847567](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=2847567)). En evaluación en *The World Economy*

[15] Jonatan Groba y Pedro Serrano, "Foreign Monetary Policy and Firms' Default Risk" ([https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=2744607](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=2744607)). En evaluación en *European Journal of Finance*

[16] María del Carmen Boado-Penas, Humberto Godínez-Olivares, Steven Haberman y Pedro Serrano, "Automatic Balancing Mechanisms for Mixed Pension Systems under Different Investment Strategies" En evaluación en *European Journal of Finance*

[17] Isabel Figuerola-Ferreti, Tao Tang, Pedro Serrano y Antoni Vaello, "Supercointegrated" ([https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=3005358](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=3005358)) Finalizado y pendiente de envío para su evaluación a *Management Science*  
Nota: Top-10 en la lista diaria de artículos más descargados en SSRN (28/08/2017).

[18] Irma Alonso y Pedro Serrano, "Institutional drivers of capital flows". Finalizado y pendiente de envío a evaluación.

## Investigación en curso

[19\*] Pedro Serrano, Antoni Vaello y María M. Vich Llompart, "Why so different? Understanding the behavior of risk aversion in developed economies". Porcentaje de finalización: 80%

[20\*] Luciana M. Orozco, Lidia Sanchís-Marco y Pedro Serrano, "Sovereign debt ownership and uncertainty". Porcentaje de finalización: 70%.

[21\*] Irma Alonso, Pedro Serrano y Antoni Vaello "Unconventional Monetary Policy and risk-neutral distributions". Porcentaje de finalización: 40%.

## **B.2. Dirección de proyectos de investigación**

[1] Título del proyecto: El impacto de los inversores no-residentes en la deuda soberana  
Código proyecto en la UC3M: 2016/00513/001  
Entidad Financiadora: Fundación Ramón Areces  
Fecha inicio: 28/10/2016 Fecha fin: 28/10/2018

## **B.3. Participación en proyectos de I+D+i**

[1] Investigador Principal (IP). Proyecto: "El impacto de los inversores no-residentes en la deuda soberana". Fundación Ramón Areces. Cuantía: 35.000 euros. Fecha inicio: 28/10/2016. Fecha fin: 28/10/2018

[2] Miembro investigador. Proyecto: "Instituciones y cambio tecnológico: lecciones de la crisis sobre valoración de activos, gestión de inversiones y regulación." Código: 2016/00118/001. IP: J.M. Marín y J. Penalva. Ministerio de Economía y Competitividad. Fecha inicio: 01/01/2016. Fecha fin: 01/01/2019.

[3] Miembro investigador. Proyecto: "Estructura de capital, rendimiento de acciones, bonos corporativos y derivados de permutas de riesgo crediticio: Interacciones e implicaciones para las empresas industriales." IP: G. Rubio. Código: MEC ECO2012-34268. Ministerio de Economía y Competitividad. Fecha inicio: 01/01/2013. Fecha fin: 01/01/2015.

[4] Miembro investigador. Proyecto: "Valoración de productos financieros complejos." IP: F.J. Fernández-Navas. Código: P08-SEJ-03917. Junta de Andalucía. Fecha inicio: 01/01/2009. Fecha fin: 31/12/2012.

[5] Miembro investigador. Proyecto: "Valoración de activos derivados y gestión de riesgos en mercados financieros y energéticos." IP: M. Moreno. Código: JCCM PPII1 1-0290-0305. Junta de Comunidades de Castilla La Mancha. Fecha inicio: 01/01/2011. Fecha fin: 31/12/2014.

[6] Miembro investigador. IP: D. Moreno. Código: CCG10-UC3M/HUM-5237. Comunidad de Madrid. Fecha inicio: 01/01/2011. Fecha fin: 31/12/2011.

[7] Miembro investigador. Proyecto: "Valoración de riesgos financieros." IP: G. Rubio. Código: MEC ECO2008-03058. Ministerio de Educación y Ciencia. Fecha inicio: 01/01/2009. Fecha fin: 31/12/2011.

[8] Miembro investigador. Proyecto: "DEC: Nuevos desarrollos en análisis económico". I.P.: J.M. Usategui. Código: GIU06/53. Gobierno Vasco. Fecha inicio: 01/01/2007. Fecha fin: 31/12/2007.

[9] Miembro investigador. Proyecto: Comportamiento estratégico, organización en redes y regulación de mercados. Código: BEC2003-02084. I.P.: J.M. Usategui. Ministerio de Educación y Ciencia. Fecha de inicio: 01/12/2003. Fecha fin: 31/12/2006.

## **B.4. Dirección de Tesis**

[1] Título: Optimal Portfolio Strategies of Cointegrated Assets.  
Doctorando: Tao Tang.  
Codirectores: Isabel Figuerola-Ferretti (ICADE) y Pedro Serrano (UC3M).  
Fecha de lectura: 04/07/2017. Lugar: Universidad Carlos III de Madrid.  
Primer puesto de trabajo: Jinan University, China.

**[2]** Título: Three essays on the interest rate curve multiplicity in the interbank market.  
Doctorando: Nuria Petit Montserrat.  
Codirectores: Juan Ángel Lafuente (UJI) y Pedro Serrano (UC3M).  
Fecha de lectura: 29/10/2015. Lugar: Universidad Complutense de Madrid (UCM).  
Primer puesto de trabajo: Banco Santander, España.  
Premio Extraordinario de Doctorado de la UCM.

**[3]** Título: The macroeconomic sources of credit risk.  
Doctorando: Jonatan Groba Domínguez.  
Codirectores: Antonio Díaz (UCLM) y Pedro Serrano (UC3M).  
Fecha de lectura: 10/07/2013. Lugar: Universidad Carlos III de Madrid.  
Primer puesto de trabajo: University of Lancaster, Reino Unido.  
Premio Extraordinario de Doctorado de la UC3M.

**[4]** Título: Por definir  
Doctorando: Irma Alonso  
Codirectores: Álvaro Escribano (UC3M) y Pedro Serrano (UC3M).  
Fecha de lectura (esperada): mayo 2019. Lugar: Universidad Carlos III de Madrid.

### **B.5. Estancias nacionales e internacionales.**

**[1]** Visiting scholar. Graduate School of Business, Columbia University, New York, NY (EEUU).  
Sponsor: Prof. Tano Santos. Fecha inicio: 06/03/2016. Fecha fin: 29/08/2016.

**[2]** Visiting scholar. Anderson School of Management, Department of Finance, University of California Los Angeles (UCLA), Los Angeles, CA (EEUU). Sponsor: Prof. Eduardo Schwartz.  
Fecha inicio: 15/01/2011. Fecha fin: 26/01/2011.

**[3]** Visiting scholar. Departamento de Economía Financiera y Contabilidad, Universidad de Alicante, España. Sponsor: Prof. Ángel León. Fecha inicio: julio 2007. Fecha fin: diciembre 2007.

**[4]** Visiting scholar. Departamento de Economía de la Empresa, Universidad Carlos III de Madrid, Getafe, España. Sponsor: Prof. Alejandro Balbás. Fecha inicio: enero 2006. Fecha fin: junio 2006.

**[5]** Visiting scholar. Departamento de Economía y Empresa, Universitat Pompeu Fabra, Barcelona, España. Sponsor: Prof. Manuel Moreno. Fecha inicio: mayo 2005. Fecha fin: junio 2005.

### **B.6. Participación en contratos de I+D+i**

**[1\*]** Investigador principal. Proyecto: "Alternativas a la insuficiencia de las pensiones. La hipoteca inversa y las rentas vitalicias". Empresa: Instituto Santalucía. Fecha inicio: 07/05/2018. Fecha fin: 30/09/2018.

**[2\*]** Investigador principal. Proyecto: "Modelo de pricing avanzado". Empresa: Multiasistencia. En trámite.

**[3\*]** Miembro de proyecto: "Revisión, asesoramiento y certificación de material docente para los programas de certificación MiFID II". IP: Alejandro Balbás y Josep A. Tribó. En trámite.

**[4\*]** Miembro de proyecto: "Análisis de cartera institucional". IP: Álvaro Escribano y Alejandro Balbás. Fecha fin: junio 2018.

## **B.7. Ponencias en congresos nacionales e internacionales**

- [1] Paris Financial Management Conference, Ipag Business School, 17-19 de diciembre de 2018, Paris, Francia.
- [2] 25<sup>th</sup> Multinational Finance Society, 24-27 de junio de 2018, Budapest, Hungría.
- [3] Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance (MAF 2018), 4-6 de abril de 2018, Madrid, España.
- [4] Paris Financial Management Conference, Ipag Business School, 18-20 de diciembre de 2017, Paris, Francia.
- [5] XXV Foro Finanzas AEFIN, 6-7 de julio de 2017, Barcelona, España.
- [6] Research Workshop on Credit Default Swaps, Universidad de Valencia, 29 de enero de 2016, Valencia, España.
- [7] IV Meeting on International Economics, 24-25 de septiembre de 2015, Villarreal, España
- [8] XXII Foro Finanzas AEFIN, 21-22 de noviembre de 2014, Zaragoza, España.
- [9] XX Foro Finanzas AEFIN, 15-16 de noviembre de 2012, Oviedo, España (2 artículos)
- [10] 11th CREDIT, 27-28 de septiembre de 2012, Venecia, Italia (póster)
- [11] 4th International Finance and Banking Society (IFABS), 18-20 de junio de 2012, Valencia, España.  
Oct 2011
- [12] 4th Workshop on Risk Management and Insurance, 20-21 de junio de 2011, Carmona, España.
- [13] XVIII Foro Finanzas AEFIN, 18-19 de noviembre de 2010, Elche, España.
- [14] XVII Foro Finanzas AEFIN, 4-5 de noviembre de 2009, Madrid, España.
- [15] 64rd European Meeting Econometric Society, 23-27 de agosto de 2009, Barcelona, España.
- [16] 63rd European Meeting Econometric Society, 27-31 de agosto de 2008, Milán, Italia.
- [17] Xth Italian- Spanish Meeting on Financial Mathematics, 23-25 de junio de 2008, Cagliari, Italia.
- [18] XXXII Simposio Análisis Económico, 13-15 de diciembre de 2007, Granada, España.
- [19] XV Foro Finanzas AEFIN, 15-16 de noviembre de 2007, Palma de Mallorca, España (2 artículos)
- [20] Financial Management Association European Conference, mayo 2007 IESE, University of Navarra, Barcelona, España (PhD seminar).
- [21] XIV Foro Finanzas AEFIN, 16-17 de noviembre de 2006, Castellón de la Plana, España.
- [22] 9th Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics, 21-22 de septiembre de 2006, Alcalá de Henares, España.
- [23] 8th Italian-Spanish Meeting on Financial Mathematics, 29-1 de julio de 2005, Verbania Intra, Italia.
- [24] EuroWorking Group on Financial Modelling, 14-16 de octubre de 2004, Almería, España.

## **B.8. Asistencia a congresos (además de los señalados en B.7)**

- [1] EFMA Annual Meeting, 25-28 de junio de 2014, Roma, Italia.
- [2] XXI Foro Finanzas AEFIN, 14-15 de noviembre de 2013, Segovia, España.
- [3] Commodities Workshop at UC3M, 15 de octubre de 2010, Getafe, España.
- [4] Finance and Commodities Workshop at UC3M, 16 de octubre de 2009, Getafe, España.
- [5] Workshop on Macroeconomics and Finance, 5 de junio de 2009, Valencia, España.
- [6\*] CREDIT annual conference, septiembre de 2007, Venecia, Italia.
- [7] XIII Foro Finanzas, Banco de España, noviembre de 2005, Madrid, España.
- [8] XII Foro Finanzas, Universitat Pompeu Fabra, diciembre de 2004, Barcelona, España.
- [9] 7th Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics, UCLM, julio de 2004, Cuenca, España.

## **B.9. Seminarios**

- [1\*] 25/05/2017 “Sovereign debt ownership and uncertainty”, RiskLab Madrid, Madrid, España.  
(info disponible en <http://www.risklab.es/es/jornadas/2017/jornada.html>)
- [2] 31/10/2014 “The determinants of interbank multiple-term structures”, Universidad CEU - Cardenal Herrera, Elche, España.
- [3] 26/04/2013 “What drives corporate default risk premia? Evidence from the CDS market”, Universidad del País Vasco, Bilbao, España.
- [4] 10/04/2013 “What drives corporate default risk premia? Evidence from the CDS market”, Universidad de Navarra, Pamplona, España.
- [5] 29/05/2009 “An analysis of the correlation risk during the Credit Crunch”, Universidad de Castilla La Mancha, Albacete, España.
- [6] 16/06/2007 “Pricing Tranching Credit Products with Generalized Multifactor Models”, Universidad de Murcia, Murcia, España.
- [7\*] 21/05/2007 Estimation of Jump-Diffusion Processes with Shot-Noise Effects, Universidad Carlos III de Madrid, Madrid, España (Job Market)
- [8\*] 20/04/2007 Estimation of Jump-Diffusion Processes with Shot-Noise Effects, Universidad de las Islas Baleares, Palma de Mallorca, España (Job Market)
- [9] 23/03/2007 “Three Essays on Financial Economics: Econometric Methods and Valuation Techniques”, Universidad Complutense de Madrid, Madrid, España.
- [10] 30/09/2004 “Jump-Diffusion Processes with Shot-Noise Effects: An Empirical Characteristic Function Approach”, Brown Bag Seminar, Universidad del País Vasco, Bilbao, España.

## **B.10. Evaluador anónimo para revistas científicas (en paréntesis más de un artículo)**

Journal of Banking and Finance, Journal of International Money and Finance (3), Journal of the Royal Statistical Society, Quantitative Finance (2), European Journal of Operational Research (6), Energy Journal, European Journal of Finance (3), Mathematics and Computers in Simulation, Journal of Multinational Financial Management, Studies in Economics and Finance, Emerging markets, Applied Mathematical Finance, The Spanish Review of Financial Economics, Business Research Quarterly, Revista de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa, y Revista de Economía Aplicada (2).

## **B.11. Comité de tesis**

- [1] 16/01/2018 “Credit Default Swaps: A relevant researchers tool and global risk proxy”, por Karin Alejandra Martín Bujack. Director: María Teresa Corzo. ICADE - Universidad Pontificia de Comillas, Madrid, España.
- [2] 07/09/2016 “Three essays on the effect of expropriation risk on private investment”, por Diana Constanza Restrepo. Directores: Ricardo Correia y Juan I. Peña. Universidad Carlos III de Madrid, Getafe, España.
- [3\*] 13/04/2015 “Three Essays on the Cutting Edge of Credit Spread Modeling”, por Alberto Fernandez Muñoz de Morales. Director: Alfonso Novales. Universidad de Castilla La Mancha, Toledo, España.
- [4] 14/02/2013 “Essays on asset allocation”, por Gabriel Penagos. Directores: Gonzalo Rubio y Francisco Sogorb. Universidad CEU-Cardenal Herrera, Elche, España.

## **B.12. Comité científico en congresos.**

- [1 ] XIX Conference on International Economics, 28-29 de junio de 2018, Villareal, España.
- [2\*] XXV Foro Finanzas AEFIN, 6-7 de julio de 2017, Barcelona, España.  
(info disponible en <https://eventum.upf.edu/7611/section/5754/25th-finance-forum.html> )

### **B.13. Becas y premios**

[1] Fundación Ramón Areces Research Grant for Social Sciences Projects, noviembre de 2016, Madrid, España.

[2] BME Best Paper on Fixed Income para "Determinants of the multiple-term structures from interbank rates", artículo conjunto con Juan A. Lafuente y Nuria Petit, XXIII AEFIN Finance Forum, julio de 2015, Madrid, España.

[3] Beca José Castillejo para estancias de jóvenes investigadores, Ministerio de Educación, Gobierno de España. Febrero de 2011 a julio de 2011.

[4] Beca Formación Personal Investigador (FPI), Ministerio de Educación y Ciencia, Gobierno de España. Desde 1 de mayo de 2004 hasta 31 de enero de 2008.

[5] Premio Mutua Pelayo al mejor artículo en matemáticas financieras e inversiones para el artículo "Estimation of Jump-Diffusion Processes with Shot-Noise Effects", conjunto con Manuel Moreno y Winfried Stute, 9th Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics, 21-22 de septiembre de 2006, Alcalá de Henares, España.

[6\*] Beca de estudios doctorales, Fundación Bancaja, septiembre de 2002 a septiembre de 2003, Valencia, España.

### **B.14. Comentarista en congresos.**

[1] "Is Variation on Valuation Too Excessive? A Study of Mutual Fund Holdings" por Hsiu-lang Chen, XXV Foro Finanzas AEFIN, 6-7 de julio de 2017, Barcelona, España.

[2\*] "Margin Credit and Stock Return Predictability", por P. Duskar, N. Kumar y J. Allan, Paris Financial IPAG Business School, 18-20 de diciembre de 2017, París, Francia.

(info disponible en <http://khuongnguyen.free.fr/PFMC2017/PFMC2017Program.pdf>)

[3] "Dealing with dealers: sovereign CDS comovements in Europe", by M. Antón, S. Mayordomo y M. Rodríguez-Moreno, XXII Foro Finanzas AEFIN, 21-22 de noviembre de 2014, Zaragoza, España.

[4] "Credit risk in the Spanish Financial system: a saddlepoint approach", by R. García-Céspedes y M. Moreno, XXI Foro Finanzas AEFIN, 14-15 de noviembre de 2013, Segovia, España.

[5] "Delving into Risk Premia: Reconciling Evidence from the S&P 500 and VIX Derivatives", por D. Amengual, y D. Xiu, XX Foro Finanzas AEFIN, 15-16 de noviembre de 2012, Oviedo, España.

[6] "Kernel Alternatives to Approximate Operational Severity Distribution: An Empirical Application", por F. di Pietro, M.D. Oliver y A.I. Irima, XVIII Foro Finanzas AEFIN, 18-19 de noviembre de 2010, Elche, España.

[7] "Geometric Mean Maximization: An Overlooked Portfolio Approach?", por J. Estrada, XVII Foro de Finanzas AEFIN, 4-5 de noviembre de 2009, Madrid, España.

[8] "Jumps, persistence and parameter instability in stochastic volatility models", por J. del Hoyo, G. Llorente, J.L. Cendejas y C. Rivero, XV Foro Finanzas AEFIN, 15-16 de noviembre de 2007, Palma de Mallorca, España.

[9] "The Impact of Credit Rating Announcements on Spanish Corporate Fixed Income Performance: Returns, Yields and Liquidity", por A. Díaz, M.D. Fernández y P. Abad. XIV Foro de Finanzas AEFIN, 16-17 de noviembre de 2006, Castellón de la Plana, España.

## **B.15. Chairman en congresos.**

**[1\*]** Paris Financial Management Conference, Ipag Business School, 18-20 de diciembre de 2017, Paris, Francia

(info disponible en <http://khuongnguyen.free.fr/PFMC2017/PFMC2017Program.pdf>)

**[2\*]** XXV Foro Finanzas AEFIN, 6-7 de julio de 2017, Barcelona, España.

**[3]** XVII Foro Finanzas AEFIN, Session 23: Asset Pricing V, 4-5 de noviembre de 2009, Madrid, España.

**[4\*]** XV Foro Finanzas AEFIN, Volatility Modelling Session, 15-16 de noviembre de 2007, Palma de Mallorca, España.

## **B.16. Cursos atendidos y otras certificaciones**

**[1\*]** Big Data Course in Coursera – University of California San Diego (5 certifications)

(ver en <https://www.linkedin.com/in/pedro-serrano-024095b/>)

**[2]** “Behavioral finance: Speculative bubbles and financial crisis”, por H. Hong, septiembre de 2010, EEF-CEMFI, Madrid, España.

**[3]** “Tratamiento de la información y modelos de datos de panel”, por J. Pindado y C. de la Torre, julio de 2010, Salamanca, España.

**[4]** “Credit Risk Modeling”, por D. Lando, septiembre de 2009, EEF-CEMFI, Madrid, España.

**[5]** “EDEN Doctoral Seminar on Credit Risk Modelling”, por L. Pelizzon, S. Schaefer e I. Strebulaev, septiembre de 2006, Venecia, Italia.

**[6\*]** “Stochastic Calculus with Applications in Finance”, por M. Fritelli, septiembre de 2005, Verbania Intra, Italia.

**[7]** Curso de Lenguajes de Programación (1391), Duración 409 horas. 24 de diciembre de 2004, Bilbao, España.

## Parte C. MÉRITOS DE DOCENCIA

### C.1. Docencia en titulaciones oficiales

- Formo parte de la Universidad Carlos III de Madrid (UC3M) como profesor visitante desde el 1 de febrero de 2008. Desde entonces, he impartido docencia de forma ininterrumpida durante 10 años.
- Puedo acreditar experiencia docente universitaria a tiempo completo con **más de 1700 horas** impartidas. El 100% de la docencia ha sido impartida con el grado de doctor.
- A continuación, resumo el tipo docencia, el total horas impartidas en ese tipo de docencia, y las horas docencia en inglés. Incluyo asimismo el porcentaje de horas en inglés (en paréntesis) sobre el total de horas.

[1] Docencia Grado: 1321.5 horas / 213.5 horas (16.16%)

[2] Docencia Postgrado (másters anteriores a 2012/2013): 75.5 h. / 75.5 h. (100.00%)

[3] Docencia Postgrado (másters posteriores a 2012/2013): 327.0 h./ 224.0 h. (68.50%)

- Soy o he sido profesor de las siguientes asignaturas:
  - Licenciatura: Gestión Financiera.
  - Grado: Gestión Financiera, Finanzas I, Sistemas Financieros, Economía Financiera.
  - Postgrado: Análisis financiero dinámico I, Derivatives, Business & Finance III: Risk management of non-financial institutions, Asset pricing.
- Soy o he sido profesor de las siguientes titulaciones
  - Licenciatura: Doble licenciatura en ADE y Comunicación Audiovisual; Licenciatura en ADE.
  - Grado: Grado en ADE; Grado en Finanzas y Contabilidad; Grado en Estadística y Empresa; Doble grado en Derecho y ADE; Doble Grado en Derecho y Economía; Doble grado en ADE y Estudios Internacionales.
  - Postgrado: Máster en Ciencias Actuariales y Financieras; Master in Finance; Master in Management; Master in Business and Finance; Master in Industrial Economics and Markets; Máster en Análisis Financiero y Gestión Bancaria UC3M (online).

### C.2. Docencia en otras instituciones.

[1] Escuela de Organización Industrial (EOI), Máster Global MBA (32 horas / 100% en inglés).

[2\*] Dirección General de Seguros y Fondos de Pensiones (DGSFP), Curso de Variables Annuities and Financial Modelling, (4 horas)

### C.3. Coordinador académico de las siguientes asignaturas (titulación entre paréntesis)

[1\*] Economía Financiera (ADE y ADE + Estudios Internacionales)

[2\*] Asset Pricing (Master in Business and Finance)

[3\*] Derivatives (Master in Finance)

[4\*] Análisis Financiero Dinámico I (Máster en Ciencias Actuariales y Financieras)

[5\*] Trabajos Fin de Máster (Máster en Ciencias Actuariales y Financieras)

#### **C4. Miembro proyecto innovación docente y comisiones de calidad**

[1] Miembro del proyecto de innovación docente durante el curso académico 2009/2010.- Título proyecto: Innovación: Adaptación de la docencia de las asignaturas de SEGUNDO CURSO de Grado y de Ingeniería Industrial y de Telecomunicación.

[2] Miembro de Comisión Académica de Titulación - Sistema de Garantía Interna de Calidad UC3M:

Grado en Finanzas y Contabilidad - Curso 2009/2010

Grado en Estadística y Empresa – Cursos 2011/2012, 2012/2013

Máster en Ciencias Actuariales y Financieras – 2014/2015, 2015/2016

#### **C5. Autor de material didáctico**

[1] Curso “Derivados OTC”, máster online en Análisis Financiero y Gestión Bancaria de la Universidad Carlos III de Madrid.

#### **C6. Certificados.**

[1] Certificado de Aptitud Pedagógica, Universitat Politècnica de Catalunya, 1 de junio de 2003.

#### **C7. Dirección de Trabajos Fin de Grado (TFG) y Trabajos Fin de Máster (TFM).**

[1] Dirección de TFGs: 6;

[2] Dirección de TFMs: 19.

#### **C.8. Indicadores de calidad de la docencia.**

[1] Más de **20 evaluaciones positivas** de la actividad docente por parte de los diferentes vicerrectores de grado por obtener una puntuación en las encuestas de satisfacción de los estudiantes mayor a 4 sobre 5.

[2] Felicitación del rector por excelencia en la docencia, al estar entre el **20% de las mejores calificaciones** docentes de la UC3M (17/07/2014).

[3\*] Obtuve en dos ocasiones el premio de docencia del Departamento de Economía de la Empresa por estar en el top 5 de las mejores puntuaciones de docencia dentro del departamento.

[4] Felicitación por excelencia en la docencia *Master in Finance*, curso 2013/2014.

## Parte D. MÉRITOS DE ADMINISTRACIÓN.

### D.1. Desempeño de cargos unipersonales de responsabilidad en gestión recogidos en los estatutos de las universidades.

**[1]** Secretario del Instituto INDEM UC3M. Fecha nombramiento: 15/07/2013. Cómputo tiempo: 3 años, 6 meses y 24 días.

Entre los logros más relevantes, desearía destacar:

- Creación y desarrollo del portal web [www.indem.uc3m.es](http://www.indem.uc3m.es)
- Desarrollo del programa certificación MiFID2 (<http://mifid2online.es/> )
- Potenciación de cursos del INDEM mediante creación de web y vídeos.

**[2]** Subdirector del Departamento de Economía de la Empresa (UC3M). Fecha nombramiento: 06/05/2015. Cómputo tiempo: 1 año, 9 meses y 3 días.

Entre los logros más relevantes, desearía destacar:

- creación y desarrollo del portal web del Departamento de Economía de la Empresa ([www.business.uc3m.es](http://www.business.uc3m.es)), que acumula más de 60,000 visitas en un año.

**[3]** Subdirector del Master de Ciencias Actuariales y Financieras, Universidad Carlos III de Madrid. Fecha de nombramiento: 1 de septiembre de 2016.

Entre los logros más relevantes, desearía destacar:

- Reacreditación en **2015** del Máster en Ciencias Actuariales y Financieras de la UC3M.

### D.2. Otros méritos relacionados con la experiencia en gestión y administración.

**[1\*]** Junio 2015 - actualidad. Responsable de Comunicación del Departamento de Economía de la Empresa.

**[2\*]** Junio 2011 - actualidad. Web Manager del Departamento de Economía de la Empresa, Universidad Carlos III de Madrid. En esta tarea, me he encargado de realizar la web del Departamento

**[3\*]** Septiembre 2010 – Junio 2011. Asistente de Web & Software. Departamento de Economía de la Empresa, Universidad Carlos III de Madrid.

**[4\*]** Septiembre 2009 - Septiembre 2010 Coordinador Erasmus. Departamento de Economía de la Empresa, Universidad Carlos III de Madrid.

**[5\*]** Septiembre 2010 - Junio 2011. Responsable de Web & Software – Departamento de Economía de la empresa, UC3M.

**[6\*]** Septiembre 2009 - Septiembre 2010. Coordinador Erasmus - Departamento de Economía de la empresa, UC3M.