



Curriculum Vitae Martín SOLA

Actualizado: 30/10/2012



Publicado: 20/07/2017

Sistema Nacional de Investigadores
Ciencias Sociales / Economía y Negocios
Categorización actual: Nivel III
Ingreso al SNI: Asociado(01/03/2010)

Datos generales

Información de contacto

E-mail: msola@utdt.edu

Institución principal

Universidad Torcuato Di Tella / Argentina

Dirección institucional

Dirección: Universidad Torcuato Di Tella / Alte. Saenz Valiente 1010 / Buenos Aires / Argentina

Teléfono: (+54 11) 5169-7331

Fax: 5169-7348

E-mail/Web: msola@utdt.edu

Formación

Formación concluida

Formación académica/Titulación

Posgrado

1987 - 1991

Doctorado

PhD Program in Economics and Econometrics

University of Southampton , Inglaterra

Título: Essays on Speculative Attacks, Speculative Bubbles and Markov-Switching Models

Tutor/es: John Driffill and Graham Mizon

Obtención del título: 1991

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Formación en marcha

Formación académica/Titulación

Posgrado

1984 - 1985

Maestría

Maestría en Economía

Centro de Estudios Macroeconómicos de Argentina , Argentina

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Grado

1980 - 1984

Grado

Licenciatura en Economía

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR, Universidad de la República , Uruguay

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Formación complementaria

Postdoctorado

10 / 1992 - 09 / 1993

Center of Economic Forecasting

London Business School , Inglaterra

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Construcción institucional

Idiomas

Inglés

Entiende (Muy Bien) / Habla (Muy Bien) / Lee (Muy Bien) / Escribe (Muy Bien)

Sistema Nacional de Investigadores

Áreas de actuación

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Actuación Profesional

Cargos desempeñados actualmente

Desde: 03/1997

Profesor , (40 horas semanales / Dedicación total) , Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Desde: 03/2004

Director del Departamento de Economía , (40 horas semanales / Dedicación total) , Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Desde: 08/1993

Profesor part-time , (40 horas semanales) , University of London , Inglaterra

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Vínculos con la institución

03/1997 - Actual, *Vínculo:* Profesor, (40 horas semanales / Dedicación total)

03/2004 - Actual, *Vínculo:* Director del Departamento de Economía, (40 horas semanales / Dedicación total)

Actividades

03/1997 - Actual

Líneas de Investigación , Departamento de Economía , Departamento de Economía

Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas , Coordinador o Responsable

03/1997 - Actual

Docencia , Grado

Riesgo Incertidumbre y Finanzas , Responsable , Licenciatura en Economía

03/1997 - Actual

Docencia , Maestría

Series de Tiempo , Responsable

03/2004 - Actual

Gestión Académica , Departamento de Economía

Director de Departamento

University of London , University of London , Inglaterra

Vínculos con la institución

08/1993 - Actual, *Vínculo:* Profesor part-time, (40 horas semanales)

Actividades

08/1993 - Actual

Docencia , Grado

Financial Econometrics , Responsable

08/1993 - Actual

Docencia , Maestría

Financial Econometrics

Federal Reserve Bank of St. Louis , Estados Unidos

Vínculos con la institución

01/2003 - 06/2003, *Vínculo:* , (40 horas semanales / Dedicación total)

04/2004 - 06/2004, *Vínculo:* , (40 horas semanales / Dedicación total)

01/2005 - 04/2005, *Vínculo:* , (40 horas semanales / Dedicación total)

Actividades

01/2005 - 04/2005

Líneas de Investigación , Research Department

State Dependent Contemporaneous Threshold Models , Coordinador o Responsable

04/2004 - 06/2004

Líneas de Investigación , Research Department

Multivariate Markov-Switching Models Using Markov Chain Monte Carlo , Coordinador o Responsable

01/2003 - 06/2003

Líneas de Investigación , Research Department

Contemporaneous Thresholds Models for Interest Rates , Coordinador o Responsable

Universidad de Montevideo , Universidad de Montevideo - Facultad de Ciencias Empresariales y Economía , Uruguay

Vínculos con la institución

03/2004 - 07/2012, *Vínculo:* , (6 horas semanales)

Actividades

03/2004 - 07/2009

Docencia , Maestría

Econometría I/Finanzas/Derivados , Invitado , Maestría en Economía

Universidad Autonoma de Barcelona , España

Vínculos con la institución

02/2010 - 05/2010, *Vínculo:* Investigador Visitante, (40 horas semanales / Dedicación total)

Pontificia Universidad Catolica del Peru , Pontificia Universidad Catolica del Peru , Perú

Vínculos con la institución

04/2011 - 04/2011, *Vínculo:* , (12 horas semanales)

Lineas de investigación

Título: Contemporaneous Thresholds Models for Interest Rates

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Equipos: Mike(Integrante)

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Título: Multivariate Markov-Switching Models Using Markov Chain Monte Carlo

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Equipos: Mike(Integrante)

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Título: Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Título: State Dependent Contemporaneous Threshold Models

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Equipos: Mike(Integrante)

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Producción científica/tecnológica

La mayor parte de mi investigación está relacionada con el desarrollo de técnicas econométricas que tomen en cuenta cambios estructurales. Con respecto a estos cambios, buscamos no sólo modelos econométricos que flexiblemente los incorporen sino también ver cómo afectan dichos cambios las expectativas de los agentes. Uno de mis primeros trabajos (Testing the Term Structure of Interest Rates from Stationary Switching Regime VAR) propone cómo testear las restricciones impuestas por la teoría económica cuando existen cambios estructurales. Esta metodología, que extiende el filtro de Hamilton para casos multivariados, se convirtió en estándar en la literatura (ver Google Scholar) de Term Structure of Interest Rates como en la discusión de aspectos metodológicos en econometría. Otra de mis contribuciones a la literatura es el diseño de tests para detectar la existencia de burbujas especulativas. Dos de los trabajos de mayor relevancia son: 1-Intrinsic Bubbles and Regime Switching, que por un lado intenta discernir entre cambios futuros esperados en los fundamentos y la existencia de burbujas especulativas, y por otro, nota que en casos en que las burbujas son una función del fundamental, si éste tiene dos regímenes la burbuja también debe tenerlos. En ese trabajo encontramos que mucha de la evidencia asignada por Froot and Obstfeld a favor de la existencia de burbujas especulativas debe ser atribuible simplemente a los efectos de cambios en los dividendos futuros. 2-Detecting Periodically Collapsing Bubbles: A Markov-Switching Unit Root Test. En ese trabajo proponemos una metodología que resuelve la crítica de Evans al uso de tests de raíces unitarias para la detección de burbujas especulativas. La metodología consiste en hacer que un filtro separe endógenamente períodos que contienen una raíz unitaria de aquellos que son explosivos. Luego este filtro se utiliza tanto para los fundamentos como para los precios. Si los precios contienen períodos explosivos donde los fundamentos no los tienen, eso es indicación de la posible existencia de una burbuja especulativa (ver Google Scholar). Gurkaynak en su paper Econometric Tests of Asset Price Bubbles, publicado en el Journal of Economic Surveys (2008), resalta la relevancia de estos tests para detectar burbujas especulativas. En el paper Instrumental-Variables Estimation on Markov-Switching Models with Endogenous Explanatory Variables: An Application to the Term Structure of Interest Rates mostramos que el uso de estimadores que no tienen en cuenta la endogeneidad de las variables cuando existe cambios de régimen, erróneamente la mayoría de las veces rechazaban las hipótesis correctas. Este trabajo, que propone un método de estimación para estas situaciones, fue premiado con el Arrow Prize for Senior Economist 2006, premio entregado por Berkeley Electronic Press. Por último, recientemente hemos propuesto una nueva clase de modelos de umbrales (Contemporaneous Threshold Autoregressive Models: Estimation, Testing and Forecasting) que hacen compatible el uso de modelos forward looking con la literatura de umbrales. Actualmente estoy explorando la importancia relativa de este tipo de modelos en distintas áreas de finanzas y macroeconomía, y extendiéndolos a situaciones en que los umbrales son dependientes del estado de la economía.

Producción bibliográfica

Artículos publicados

Arbitrados

Completo

MARTÍN SOLA; M. DUEKER; UNIVERSITY OF LONDON; FABIO SPAGNOLO

Multivariate Contemporaneous-Threshold Autoregressive Models. *Journal of Econometrics*, 2011

Palabras clave: Contemporaneous-Threshold

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03044076



SCOPUS

Completo

MARTÍN SOLA; M. DUEKER; Z. PSARADAKIS; F. SPAGNOLO

Contemporaneous-Threshold Smooth Transition GARCH Models. *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*, 2011

Palabras clave: Smooth Transition GARCH Models

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10811826

Sistema Nacional de Investigadores



SCOPUS

Completo

J. DRIFFILL; T. KENC; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

The Effects of Different Parameterizations of Markov-Switching in a CIR Model of Bond Pricing. *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*, 2009

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10811826

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO; N. SPAGNOLO

Selecting Nonlinear Time Series Models Using Information Criteria. *Journal of Time Series Analysis*, 2009

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01439782

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO; N. SPAGNOLO

Predicting Markov Volatility Switches Using Monetary Policy Variables. *Economics Letters*, 2007

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651765

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

M. DUEKER; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

Contemporaneous Threshold Autoregressive Models: Estimation, Testing and Forecasting. Journal of Econometrics, 2007

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03044076

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

Instrumental-Variables Estimation in Markov Switching Models with Endogenous Explanatory Variables: An Application to the Term Structure of Interest Rates. Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics, 2006

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10811826

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

J. DRIFILL; MARTÍN SOLA

Target Zones for Exchange Rates and Policy Changes. Journal of International Money and Finance, 2006

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 02615606

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

Testing the Unbiased Forward Exchange Rate Hypothesis Using a Markov Switching Model and Instrumental Variables. Journal of Applied Econometrics, 2005

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; M. RAYN; MARTÍN SOLA

Markov-Switching Causality and the Money-Output Relationship. Journal of Applied Econometrics, 2005

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

M. KARANASOS; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

On the Autocorrelation Properties of Long-Memory GARCH Processes. *Journal of Time Series Analysis*, 2004

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01439782

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

On Markov Error-correction Models, with an Application to Stock Prices and Dividends. *Journal of Applied Econometrics*, 2004

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Sistema Nacional de Investigadores

Completo

M. RAYBAUDI; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

Red Signals: Current Account Deficits and Sustainability. *Economics Letters*, 2004

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651765

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

J. DRIFILL; M. RAYBAUDI; MARTÍN SOLA

Investment Under Uncertainty with Stochastically Switching Profit Streams: Entry, Exit and the Business Cycle. *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*, 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10811826

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA; M. TRONZANO

Target Zones and Economic Fundamentals. *Economic Modelling*, 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 02649993

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

On Detrending and Cyclical Asymmetry. Journal of Applied Econometrics, 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO; N. SPAGNOLO

A Test for Contagion. Economics Letters, 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651765

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

V. GABRIEL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

A Simple Method of Testing for Cointegration Subject to Multiple Changes in Regime. Economics Letters, 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651765

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

A. GARRATT; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

An Empirical Reassessment of Target-Zone Nonlinearities. Journal of International Money and Finance, 2001

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 02615606

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

A Simple Procedure for Detecting Periodically Collapsing Rational Bubbles. Economics Letters, 2001

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651765

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

MARTÍN SOLA; M. TRONZANO

Assessing the Credibility of a Target Zone: evidence from EMS countries. International Journal of Finance and Economics, 2000

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10769307

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

R. SMITH; MARTÍN SOLA; F. SPAGNOLO

The Prisoner's Dilemma and Regime-Switching in the Greek-Turkish Arms Race. *Journal of Peace Research*, 2000

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 00223433

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

S. HALL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

Detecting Periodically Collapsing Bubbles: A Markov-Switching Unit Root Test. *Journal of Applied Econometrics*, 1999

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

J. DRIFFILL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

On Testing the Expectations Hypothesis of the Term Structure Using Instrumental Variables. *International Journal of Finance and Economics*, 1998

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10769307

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

Finite-Sample Properties of the Maximum Likelihood Estimator in Autoregressive Models with Markov Switching. *Journal of Econometrics*, 1998

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03044076

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

MARTÍN SOLA; J. DRIFFILL

Intrinsic Bubbles and Regime Switching. *Journal of monetary economics*, 1998

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03043932

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

M. FUNKE; S. HALL; MARTÍN SOLA

Empirical Properties of the Black Market Zloty/Dollar Exchange Rate, 1988-1990. International Journal of Finance and Economics, 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10769307

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

S.HALL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

Switching Error-Correction Models of House Prices in the United Kingdom. Economic Modelling, 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 02649993

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Sistema Nacional de Investigadores

Completo

J. DRIFILL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

A Reconciliation of Some Paradoxical Empirical Results on the Expectation Model of the Term Structure. Oxford Bulletin of Economics and Statistics, 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03059049

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

S. HALL; Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

Changes in Regime and Cointegration: The Japanese Consumption Function. Journal of Applied Econometrics, 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 08837252

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

K. BLACKBURN; MARTÍN SOLA

Testing for Bubbles in the German Hyperinflation. International Journal of Finance and Economics, 1996

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 10769307

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Completo

Z. PSARADAKIS; MARTÍN SOLA

On the Power Tests for Superexogeneity and Structural Invariance. Journal of Econometrics, 1996

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03044076

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

K. BLACKBURN; F. ORDUNA; MARTÍN SOLA

Exponential Smoothing and Spurious Autocorrelation. Applied economics letters (Print), 1995

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 13504851

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



Sistema Nacional de Investigadores

Completo

M. RAVN; MARTÍN SOLA

Stylized Facts and Changes in Regime: Are Prices Pro-Cyclical?. Journal of monetary economics, 1995

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 03043932

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

J. DRIFILL; MARTÍN SOLA

Testing the Term Structure of Interest Rates from a Stationary Switching Regime VAR. Journal of economic dynamics & control, 1994

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 01651889

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

M. FUNKE; S. HALL; MARTÍN SOLA

Rational Bubbles During Poland's Hyperinflation: Implications and Empirical Evidence. European Economic Review, 1994

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 00142921

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

M. RAVN; MARTÍN SOLA

The Use of Recursive Variance Plots: A Note. Applied Economics, 1993

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00036846

El criterio para el orden de los autores es alfabético.



SCOPUS

Completo

K. BLACKBURN; MARTÍN SOLA

Collapsing Exchange Rate Regimes: A Survey. Journal of Economic Surveys, 1993

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

ISSN: 09500804

El criterio para el orden de los autores es alfabético.

SCOPUS

Sistema Nacional de Investigadores

Artículos aceptados

Arbitrados

Completo

MARTÍN SOLA; Z. PSARADAKIS; M. DUEKER; F. SPAGNOLO

State -Dependent Threshold STAR Models. Oxford Bulletin of Economics and Statistics, 2012

ISSN: 03059049



SCOPUS

Capitulos de Libro

Capítulo de libro publicado

MARTÍN SOLA; M. RAVN

A Reconsideration of the Empirical Evidence of the Asymmetric Effects of Money Supply Shocks: Positive vs. Negative or Big vs. Small , 2004

Libro: The Federal Reserve Bank of St. Louis Review. v.: 86-5,

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Capítulo de libro publicado

MARTÍN SOLA; M. RAVN

Business Cycle Dynamics: Predicting Transitions with Macrovariables , 1999

Libro: Nonlinear Time Series Analysis of Economic and Financial Data. p.: 231 - 263,

Organizadores: Phillip Rothman

Editorial: Kluwer Academic Press

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Capítulo de libro publicado

MARTÍN SOLA; J. DRIFILL

Testing the Present Value Hypothesis from a Vector Autoregression with Stochastic Regime Switching , 1999

Libro: Nonlinear Time Series Analysis of Economic and Financial Data. p.: 209 - 229,

Organizadores: Phillip Rothman

Editorial: Kluwer Academic Press

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Capítulo de libro publicado

MARTÍN SOLA; S. HALL

Structural Breaks and Garch Modelling , 1996

Libro: Computational Economic Systems Models, Methods & Econometrics.

Organizadores: M. Gilli

Editorial: Kluwer Academic Press

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Sistema Nacional de Investigadores

Documentos de Trabajo

Completo

MARTÍN SOLA

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Evaluaciones

Evaluación de Publicaciones

2001 / 2012

Nombre: Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics,

Cantidad: Mas de 20

Editor Asociado (pertenezco al Board de la revista)

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: American Economic Review,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Review of Economic Studies,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Journal of Applied Econometrics,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Journal of Economic Dynamics and Control,

Cantidad: Menos de 5

Sistema Nacional de Investigadores

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics,

Cantidad: De 5 a 20

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: International Economic Review,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Applied Financial Economics,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2012

Nombre: Review of Economics and Statistics,

Cantidad: Menos de 5

Sistema Nacional de Investigadores

Formación de RRHH

Tutorías concluidas

Posgrado

Tesis de doctorado

--- , 2006

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Andreopoulos, Spyros

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

Long Run Relations and Structural Change , 2006

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Vasco, Gabriel

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Sistema Nacional de Investigadores

Tesis de doctorado

Nonlinear Error-Correction Models with Regime Switching , 2001

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Spagnolo, Fabio

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

Three Essays on Markov Switching Models , 2001

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Spagnolo, Nicola

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

Essays on Assessing the Credibility of a Target Zone , 2000

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Tronzano, Marco

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Grado

Tesis/Monografía de grado

Predicción del Crecimiento Económico en un modelo con restricciones de no arbitraje , 2012

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Clara Gianola

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Palabras clave: No arbitraje

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

Inflación en Argentina 2003 - 2011 , 2011

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Capriotti Manuela Ines

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Palabras clave: Inflación

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

Tipo de Cambio Sombra , 2011

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Javier Balestra

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Palabras clave: TIPO DE CAMBIO SOMBRA

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Tassara, Martín

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Baumann Fonay, Iván

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Lopez Murphy, Ezequiel

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Bronstein Lema, Gaspar

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2006

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Moisés, Federico

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2006

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Kravetz, Sabrina

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2006

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Kuczer, Miguel

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Tesis/Monografía de grado

--- , 2005

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Vallejos, Lucas Miguel

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2005

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Rched, Alejandro Hamil

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2005

Sistema Nacional de Investigadores

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Fernandez Vidal, María

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2005

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Greco, Jorge Esteban

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2005

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Lembeye, Ignacio

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Sistema Nacional de Investigadores

Tesis/Monografía de grado

--- , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Kasztelan, Nora Lucía

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Wassiliu, Alejandro

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Vanasco, Victoria Magdalena

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Zarzecki, Marcela

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tesis/Monografía de grado

--- , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Tesler, Florencia Sol

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina , Licenciatura en Economía

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Otras

Iniciación a la investigación

Inflation Targeting in Uruguay , 2012

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Matias Escudero

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Palabras clave: Inflation Targetting

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Inglés

Información adicional: Beca de Investigacion

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación UTDT , 2008

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Navarro, Gastón

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación CONICET , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Francetich, Alejandro

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación CONICET , 2007

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Passadore, Juan

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación UTDT , 2006

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Filippini, Federico

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación UTDT , 2005

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Fajgelbaum, Pablo

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación UTDT , 2005

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Vanasco, Victoria

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Iniciación a la investigación

Beca de Investigación UTDT , 2004

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Pouzo, Demián

Universidad Torcuato Di Tella , Argentina

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Argentina/Español

Tutorías en marcha

Posgrado

Tesis de doctorado

--- , 2008

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Dixon, Peter

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

--- , 2008

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Di Pace, Federico Nicolás

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

--- , 2007

Sistema Nacional de Investigadores

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Brun-Aguerre, Raphael

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

--- , 2007

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Kim, Young-Bae

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

--- , 2005

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Yellatti, Hernán

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Tesis de doctorado

--- , 2005

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Chabane, Karim Ait

University of London , Inglaterra , PhD Program in Economics

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Econometría Financiera y Finanzas

Pais/Idioma: Inglaterra/Inglés

Otros datos relevantes

Premios y títulos

2006 Arrow Prize for Senior Economists (Internacional) Berkeley Electronic Press

Begun in 2003, the Arrow Prize for Junior and Senior Economists recognizes two papers published each year in bepress economics journals that make an outstanding contribution to economics. Each award carries an honorarium and an announcement to the Berkeley Electronic Press network of 65,000 economists.

1996 Roland Tress Prize (Nacional) Birkbeck College, University of London

Awarded by the Faculties of Arts, Science and Economics of Birkbeck College for high quality research.

2005 Distinguished Author (Internacional) Journal of Applied Econometrics

In recognition of the authors who have made significant contributions to this Journal, the Editorial Committee introduced in 1999 a scheme to honour those authors who have published the equivalent of three single-author articles by naming them Journal of Applied Econometrics Distinguished Authors.

Indicadores de producción

<i>Producción bibliográfica</i>	44
<i>Artículos publicados en revistas científicas</i>	38
Completo (Arbitrada)	38
<i>Artículos aceptados para publicación en revistas científicas</i>	1
Completo (Arbitrada)	1
<i>Trabajos en eventos</i>	0
<i>Libros y capítulos de libros publicados</i>	4
Capítulo de libro publicado	4
<i>Textos en periódicos</i>	0
<i>Documentos de trabajo</i>	1
Completo	1
<i>Producción técnica</i>	0
<i>Productos tecnológicos</i>	0
<i>Procesos o técnicas</i>	0
<i>Trabajos técnicos</i>	0
<i>Otros tipos</i>	0
<i>Evaluaciones</i>	9
Evaluación de Publicaciones	9
<i>Formación de RRHH</i>	39
<i>Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas</i>	33
Tesis de doctorado	5
Tesis/Monografía de grado	20
Iniciación a la investigación	8
<i>Tutorías/Orientaciones/Supervisiones en marcha</i>	6
Tesis de doctorado	6

Sistema Nacional de Investigadores