



## **BELEN ADORACION NIETO DOMENECH**

Generado desde: Universidad de Alicante

Fecha del documento: 13/07/2023

**v 1.4.0**

44658371c4454350660b2c523ff29ef9

Este fichero electrónico (PDF) contiene incrustada la tecnología CVN (CVN-XML). La tecnología CVN de este fichero permite exportar e importar los datos curriculares desde y hacia cualquier base de datos compatible. Listado de Bases de Datos adaptadas disponible en <http://cvn.fecyt.es/>



## BELEN ADORACION NIETO DOMENECH

Apellidos: **NIETO DOMENECH**  
Nombre: **BELEN ADORACION**  
DNI:  
Fecha de nacimiento: **18/01/1972**  
Sexo: **Mujer**  
Nacionalidad: **España**  
País de nacimiento: **España**  
Teléfono fijo:  
Correo electrónico: **belen.nieto@ua.es**

### Situación profesional actual

**Entidad empleadora:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Departamento:** ECONOMIA FINANCIERA Y CONTABILIDAD, FACULTAD CC ECONOMICAS Y EMPRESARIALE  
**Categoría profesional:** CATEDRATICO/A DE UNIVERSIDAD **Gestión docente (Sí/No):** No  
**Fecha de inicio:** 21/07/2020  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo  
**Funciones desempeñadas:** CATEDRATICO/A DE UNIVERSIDAD



## Formación académica recibida

### Titulación universitaria

Estudios de 1º y 2º ciclo, y antiguos ciclos (Licenciados, Diplomados, Ingenieros Superiores, Ingenieros Técnicos, Arquitectos)

**Titulación universitaria:** Titulado Superior

**Nombre del título:** Licenciada en Ciencias Económicas y Empresariales.

**Entidad de titulación:** Universidad de Alicante.

**Fecha de titulación:** 30/06/1995

**Título homologado:** No

### Doctorados

- 1 Programa de doctorado:** Doctora en Ciencias Económicas y Empresariales.  
**Entidad de titulación:** Universidad de Alicante.  
**Fecha de titulación:** 30/03/2001  
**Doctorado Europeo:** No  
**Mención de calidad:** No  
**Premio extraordinario doctor:** No  
**Título homologado:** No
- 2 Programa de doctorado:** DOCTORADO EN ANÁLISIS ECONÓMICO APLICADO  
**Entidad de titulación:** Centro de Estudios de Doctorado y Posgrado  
**Fecha de titulación:** 30/03/2001  
**Doctorado Europeo:** No  
**Director/a de tesis:** GONZALO ARTURO RUBIO IRIGOYEN  
**Mención de calidad:** No  
**Premio extraordinario doctor:** No  
**Título homologado:** No



## Experiencia científica y tecnológica

### Actividad científica o tecnológica

#### Proyectos de I+D+i financiados en convocatorias competitivas de Administraciones o entidades públicas y privadas

- 1 Nombre del proyecto:** Incertidumbre, Conexiones en Volatilidad, y los Efectos de las Fricciones en los Precios de los Activos Financieros y la Actividad Real  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Nieto, B.  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:** MINISTERIO DE ECONOMIA Y EMPRESA  
**Cód. según financiadora:** PGC2018-095072-B-I00  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2019 - 31/12/2021 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 60.863 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo
- 2 Nombre del proyecto:** Expectations, Asset Prices, and Market Frictions  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Rubio-Irigoyen, G.  
**Nº de investigadores/as:** 3  
**Entidad/es financiadora/s:** Conselleria de Educación de la Generalitat Valenciana  
**Cód. según financiadora:** PROMETEO/2017/158  
**Fecha de inicio-fin:** 01/11/2017 - 31/10/2021 **Duración:** 4 años  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 3 Nombre del proyecto:** Relaciones entre variables macroeconómicas y precios de activos financieros y sus consecuencias para finanzas corporativas  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Nieto, B.  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:** MINISTERIO DE ECONOMIA Y EMPRESA  
**Cód. según financiadora:** ECO2015-67035-P  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2016 - 31/12/2018 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 27.951 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo



**4 Nombre del proyecto:** Identificación y predicción de shocks sistémicos. Análisis de los determinantes macroeconómicos de los riesgos financieros y sus implicaciones transversales

**Ámbito geográfico:** Otros

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nº de investigadores/as:** 2

**Entidad/es financiadora/s:**

Banco de España

**Cód. según financiadora:** Sin referencia

**Fecha de inicio-fin:** 27/10/2016 - 26/10/2018

**Duración:** 2 años

**Entidad/es participante/s:** UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID

**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial

**5 Nombre del proyecto:** Interconnections between capital structure and asset pricing

**Ámbito geográfico:** Otros

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Rubio-Irigoyen, G.

**Nº de investigadores/as:** 3

**Entidad/es financiadora/s:**

Conselleria de Educació de la Generalitat Valenciana

**Cód. según financiadora:** PROMETEOII/2013/015

**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2013 - 31/12/2016

**Duración:** 4 años

**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial

**6 Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera

**Ámbito geográfico:** Otros

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel

**Nº de investigadores/as:** 8

**Entidad/es financiadora/s:**

UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Cód. según financiadora:** VIGROB-226

**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2015 - 31/12/2015

**Duración:** 1 año

**Cuantía total:** 893 €

**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial

**7 Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera

**Ámbito geográfico:** Otros

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel

**Nº de investigadores/as:** 8

**Entidad/es financiadora/s:**

UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Cód. según financiadora:** VIGROB-226

**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2014 - 31/12/2014

**Duración:** 1 año

**Cuantía total:** 795 €

**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial



- 8** **Nombre del proyecto:** Métodos econométricos: aspectos teóricos y aplicaciones en economía laboral y finanzas  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Mora, J.  
**Nº de investigadores/as:** 16  
**Entidad/es financiadora/s:**  
MINISTERIO DE ECONOMIA Y EMPRESA  
**Cód. según financiadora:** ECO2011-29751  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2012 - 31/12/2014 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 129.046,5 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo
- 9** **Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 9  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-226  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2013 - 31/12/2013 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 1.045 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 10** **Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 9  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-226  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2012 - 31/12/2012 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 1.712 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 11** **Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-226  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2011 - 31/12/2011 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 2.183 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial



- 12** **Nombre del proyecto:** Factores determinantes. Análisis y aplicaciones en la relación rentabilidad-riesgo  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 11  
**Entidad/es financiadora/s:**  
MINISTERIO DE EDUCACION  
  
**Cód. según financiadora:** ECO2008-02599  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2009 - 31/12/2011 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 70.180 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo
- 13** **Nombre del proyecto:** Factores determinantes, análisis y aplicaciones en la relación rentabilidad-riesgo  
**Ámbito geográfico:** Autonómica  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 11  
**Entidad/es financiadora/s:**  
GENERALITAT VALENCIANA  
  
**Cód. según financiadora:** ACOMP/2010/067  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2010 - 31/12/2010 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 800 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 14** **Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-226  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2010 - 31/12/2010 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 2.444 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 15** **Nombre del proyecto:** Finanzas de Mercado y Econometría Financiera  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-226  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2009 - 31/12/2009 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 1.951 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial



- 16** **Nombre del proyecto:** Analysis on Empirical Aspects of the Spanish and US Stock Markets: Volatility Modelling, Microstructure and Asset Pricing.  
**Ámbito geográfico:** Autonómica  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** RUBIA, A.  
**Nº de investigadores/as:** 4  
**Entidad/es financiadora/s:**  
GENERALITAT VALENCIANA  
**Cód. según financiadora:** GVPRE/2008/316  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2008 - 31/12/2008 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 22.250 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 17** **Nombre del proyecto:** Transmisión de información a través de los analistas financieros: asimetría, valoración y sesgos  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 13  
**Entidad/es financiadora/s:**  
MINISTERIO DE EDUCACION  
**Cód. según financiadora:** SEJ2005-09372  
**Fecha de inicio-fin:** 15/10/2005 - 14/10/2008 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 63.665 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo completo
- 18** **Nombre del proyecto:** Análisis empírico de la asimetría informativa y sus consecuencias en el mercado español  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** RUBIA, A.  
**Nº de investigadores/as:** 5  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** GRJ06-13  
**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2007 - 31/12/2007 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 8.898 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 19** **Nombre del proyecto:** Finanzas y mercado  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 21  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-056  
**Fecha de inicio-fin:** 01/10/2005 - 30/09/2007 **Duración:** 2 años  
**Cuantía total:** 2.970,12 €



**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial

- 20** **Nombre del proyecto:** Finanzas y mercado  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 20  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-056  
**Fecha de inicio-fin:** 01/10/2004 - 31/12/2005 **Duración:** 1 año - 3 meses  
**Cuantía total:** 3.440,68 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 21** **Nombre del proyecto:** Intensidad de negociación informada en mercados dirigidos por órdenes.  
**Ámbito geográfico:** Nacional  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 8  
**Entidad/es financiadora/s:**  
MINISTERIO DE ECONOMIA Y EMPRESA  
**Cód. según financiadora:** BEC2002-03797  
**Fecha de inicio-fin:** 01/08/2002 - 31/07/2005 **Duración:** 3 años  
**Cuantía total:** 39.928 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 22** **Nombre del proyecto:** Finanzas y mercados  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 20  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** VIGROB-056  
**Fecha de inicio-fin:** 01/12/2003 - 01/12/2004 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 4.190,1 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial
- 23** **Nombre del proyecto:** Finanzas y Mercados  
**Ámbito geográfico:** Otros  
**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.  
**Nº de investigadores/as:** 20  
**Entidad/es financiadora/s:**  
UNIVERSIDAD DE ALICANTE  
**Cód. según financiadora:** Sin determinar  
**Fecha de inicio-fin:** 26/09/2002 - 25/09/2003 **Duración:** 1 año  
**Cuantía total:** 4.408,4 €  
**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial

**24 Nombre del proyecto:** Anomalías empíricas en el mercado de capitales españoles**Ámbito geográfico:** Autonómica**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.**Nº de investigadores/as:** 6**Entidad/es financiadora/s:**

GENERALITAT VALENCIANA

**Cód. según financiadora:** GV97-EJ-16-79**Fecha de inicio-fin:** 01/01/1998 - 31/12/1999**Duración:** 2 años**Cuantía total:** 7.031,84 €**Régimen de dedicación:** Tiempo parcial**Contratos, convenios o proyectos de I+D+i no competitivos con Administraciones o entidades públicas o privadas****1 Nombre del proyecto:** CONSUMPTION, LIQUIDITY AND THE CROSS-SECTIONAL VARIATION OF EXPECTED RETURNS**Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Nieto, B.**Nº de investigadores/as:** 1**Entidad/es financiadora/s:**

INSTITUTO VALENCIANO DE INVESTIGACIONESECONOMICAS SA

**Cód. según financiadora:** IVIE4-09I**Fecha de inicio:** 08/07/2009**Duración:** 4 meses**Cuantía total:** 4.000 €**2 Nombre del proyecto:** ESTUDIOS DE INVESTIGACIÓN Y TRABAJOS EN EL ÁREA DE ADMINISTRACIÓN, AUDITORÍA, GESTIÓN FINANCIERA, MERCADOS DE CAPITAL Y TESORERÍA**Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.**Nº de investigadores/as:** 20**Entidad/es financiadora/s:**

FUNDACION DE LA COMUNITAT VALENCIANA OBRA SOCIAL DE CAJA MEDITERRANEO

**Cód. según financiadora:** CAM1-08D**Fecha de inicio:** 01/02/2008**Duración:** 1 año**Cuantía total:** 40.000 €**3 Nombre del proyecto:** ESTUDIO DE VALORACIÓN DE EMPRESA, PROYECTOS E INVERSIONES**Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** León Valle, Ángel**Nº de investigadores/as:** 20**Entidad/es financiadora/s:**



EUROVALORACIONES, SA

**Cód. según financiadora:** EUROVAL1-07T

**Fecha de inicio:** 18/06/2007

**Duración:** 2 años

**Cuantía total:** 0 €

**4 Nombre del proyecto:** TRABAJOS DE INVESTIGACIÓN EN EL ÁREA DE ADMINISTRACIÓN, AUDITORIA, GESTIÓN FINANCIERA...

**Ámbito geográfico:** Nacional

**Grado de contribución:** Investigador/a

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.

**Nº de investigadores/as:** 13

**Entidad/es financiadora/s:**

FUNDACION DE LA COMUNITAT VALENCIANA OBRA SOCIAL DE CAJA MEDITERRANEO

**Cód. según financiadora:** CAM4-06D

**Fecha de inicio:** 02/02/2006

**Duración:** 1 año

**Cuantía total:** 40.000 €

**5 Nombre del proyecto:** TRABAJOS DE INVESTIGACIÓN EN EL ÁREA DE ADMINISTRACIÓN, AUDITORÍA, GESTIÓN FINANCIERA, MERCADO DE CAPITALES Y TESORERÍA.

**Ámbito geográfico:** Nacional

**Grado de contribución:** Investigador/a

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.

**Nº de investigadores/as:** 15

**Entidad/es financiadora/s:**

FUNDACION DE LA COMUNITAT VALENCIANA OBRA SOCIAL DE CAJA MEDITERRANEO

**Cód. según financiadora:** CAM2-05I

**Fecha de inicio:** 03/03/2005

**Duración:** 1 año

**Cuantía total:** 40.000 €

**6 Nombre del proyecto:** EJECUCIÓN DE ESTUDIO EN EL ÁREA FINANCIERA

**Ámbito geográfico:** Nacional

**Grado de contribución:** Investigador/a

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.

**Nº de investigadores/as:** 20

**Entidad/es financiadora/s:**

FUNDACIÓN DE ESTUDIOS FINANCIEROS-INSTITUTO ESPAÑOL DE ANALISTAS FINANCIEROS

**Cód. según financiadora:** ESTUDIOSFINANCIEROS1-04T

**Fecha de inicio:** 24/09/2004

**Duración:** 1 año

**Cuantía total:** 23.225 €

**7 Nombre del proyecto:** EJECUCIÓN DE ESTUDIOS EN EL ÁREA FINANCIERA

**Ámbito geográfico:** Nacional

**Grado de contribución:** Investigador/a

**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE

**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Gómez-Sala, J.C.

**Nº de investigadores/as:** 25

**Entidad/es financiadora/s:**

FUNDACIÓN DE ESTUDIOS FINANCIEROS-INSTITUTO ESPAÑOL DE ANALISTAS FINANCIEROS

**Cód. según financiadora:** ESTUDIOSFINANCIEROS1-03T**Fecha de inicio:** 28/03/2003**Duración:** 1 año**Cuantía total:** 22.620 €**8 Nombre del proyecto:** VALORACIÓN DE ACTIVOS EN EL MERCADO BURSÁTIL ESPAÑOL: TRES ENSAYOS**Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** UNIVERSIDAD DE ALICANTE**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Nieto, B.**Nº de investigadores/as:** 1**Entidad/es financiadora/s:**

INSTITUTO VALENCIANO DE INVESTIGACIONESECONOMICAS SA

**Cód. según financiadora:** IVIE5-01I**Fecha de inicio:** 29/03/2001**Duración:** 8 meses**Cuantía total:** 3.606,07 €

## Actividades científicas y tecnológicas

### Producción científica

#### Publicaciones, documentos científicos y técnicos

- 1** Nieto, B.; Abad, D.; Roberto Pascual; Gonzalo Rubio. Market-wide illiquidity and the distribution of non-parametric stochastic discount factors. *International Review of Financial Analysis*. 87/May 2023, pp. 1 - 17. (Holanda): 05/04/2023. ISSN 1057-5219  
**DOI:** <https://doi.org/10.1016/j.irfa.2023.102650>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 4
- 2** Gonzalez-Urteaga, A.; Nieto, B.; Gonzalo Rubio. Spillover dynamics effects between risk-neutral equity and Treasury volatilities. *SERIEs: Journal of the Spanish Economic Association*. 13, pp. 663 - 708. 06/06/2022. ISSN 1869-4187  
**DOI:** 10.1007/s13209-022-00264-w  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 3
- 3** Nieto, B.; Gonzalo Rubio. The effects of the COVID-19 crisis on risk factors and option-implied expected market risk premia: An international perspective. *Journal of Risk and Financial Management*. 15/1, pp. 13. 03/01/2022. ISSN 1911-8066  
**DOI:** <https://doi.org/10.3390/jrfm15010013>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2



- 4** Gonzalez-Urteaga, A.; Nieto, B.; Rubio-Irigoyen, G. On the behavior of the Spanish capital market . Serie de documentos de trabajo de la CNMV. 80, 2022.  
**Otro tipo de identificador:** [https://www.cnmv.es/portal/Publicaciones/Pub\\_Monografias.aspx#80](https://www.cnmv.es/portal/Publicaciones/Pub_Monografias.aspx#80)  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 3
- 5** Nieto, B.; Rubio, G. The risk aversion and uncertainty channels between finance and macroeconomics. Finance Research Letters. 45/March, pp. 102188. (Holanda): 2022. ISSN 1544-6123  
**DOI:** <https://doi.org/10.1016/j.frl.2021.102188>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 6** Gonzalez-Urteaga, A.; Nieto, B.; Rubio, G. Extracting expected stock risk premia from option prices and the information contained in non-parametric-out-of-sample stochastic discount factors. Quantitative Finance. 21/5, pp. 713 - 727. (Reino Unido): 2021. ISSN 1469-7688  
**DOI:** <https://doi.org/10.1080/14697688.2020.1813903>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 3
- 7** Nieto, B.; Rubio, G. Factor investing en la Bolsa española: El impacto del Covid-19. FundsPeople. 134, pp. 78 - 80. 2020.  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 8** Nieto, B.; Rubio, G. The Coronavirus Impact on Stock Returns in Spain. Bolsa. Revista Mensual de Bolsas y Mercados Españoles. Mayo, 2020. ISSN 0211-5336  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 9** Gonzalez-Urteaga, A.; Nieto, B.; Rubio, G. A forecasting analysis of risk-neutral equity and Treasury volatilities. Journal of Forecasting. 38, pp. 681 - 698. (Estados Unidos de América): 2019. ISSN 0277-6693  
**DOI:** <https://doi.org/10.1002/for.2591>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 3
- 10** León Valle, Ángel; León, A; Navarro, L.; Nieto, B. Screening rules and portfolio performance. North American Journal of Economics and Finance. 48, pp. 642 - 662. (Holanda): 2019. ISSN 1062-9408  
**DOI:** <https://doi.org/10.1016/j.najef.2018.08.001>  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 4  
**Nº total de autores:** 4
- 11** Nieto, B.; Nieto, B. Bid-ask spread estimator from high and low daily prices: Practical implementation for corporate bonds. Journal of Empirical Finance. 48, pp. 36 - 57. (Holanda): 2018. ISSN 0927-5398  
**DOI:** <https://doi.org/10.1016/j.jempfin.2018.06.003>



**Tipo de producción:** Artículo científico  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 3

**Tipo de soporte:** Revista

- 12** Nieto, B.; Rodríguez, R. Corporate stock and bond return correlations and dynamic adjustments on capital structure. *Journal of Business Finance and Accounting*. 42/44322, pp. 705 - 746. (Reino Unido): 2015. ISSN 0306-686X

**DOI:** 10.1111/jbfa.12114

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 2

- 13** Nieto, B.; Novales, A.; Rubio, G. Macroeconomic and Financial Determinants of the Volatility of Corporate Bond Returns. *Quarterly Journal of Finance*. 5/4, 2015. ISSN 2010-1392

**DOI:** 10.1142/S2010139215500214

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 3

- 14** Márquez, E.; Nieto, B.; Rubio, G. Stock returns with consumption and illiquidity risks. *International Review of Economics and Finance*. 29/January, pp. 57 - 74. (Holanda): 2014. ISSN 1059-0560

**DOI:** 10.1016/j.iref.2013.04.003

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 2

**Nº total de autores:** 3

- 15** Nieto, B.; Orbe, S.; Zárraga, A. Time-varying market beta: Does the estimation methodology matter?. *SORT*. 38/1, pp. 13 - 42. (España): 2014. ISSN 1696-2281

**DOI:** 10.2436/20.8080.02.2

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 3

- 16** Nieto, B.; Novales, A.; Rubio, G. Variance Swaps, non-normality and macroeconomic and financial risks. *Quarterly Review of Economics and Finance*. 54/2, pp. 257 - 270. (Holanda): 2014. ISSN 1062-9769

**DOI:** 10.1016/j.qref.2013.12.002

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 3

- 17** Nieto, B.; Rubio, G. Volatility Bounds, Size, and Real Activity Prediction. *Review of Finance*. 18/1, pp. 373 - 415. (Reino Unido): 2014. ISSN 1572-3097

**DOI:** 10.1093/rof/rft003

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 2

- 18** Nieto, B. Comentarios al trabajo "The yield curve and real estate markets". *Moneda y Crédito*. 234, pp. 118 - 122. (España): 2012. ISSN 0026-959X

**Tipo de producción:** Artículo científico

**Tipo de soporte:** Revista

**Posición de firma:** 1

**Nº total de autores:** 1



- 19** Abad, D.; Nieto, B. Analysing Bank-Issued Option Pricing. The European Journal of Finance (Online). 17/1, pp. 49 - 65. 2011. ISSN 1466-4364  
**DOI:** 10.1080/13518471003638591  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 2
- 20** Márquez, E.; Nieto, B. Further international evidence on durable consumption growth and long-run consumption risk. Quantitative Finance. 11/2, pp. 195 - 217. (Reino Unido): 2011. ISSN 1469-7688  
**DOI:** 10.1080/14697680903067120  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 2
- 21** Nieto, B. La valoración de activos (Revista de bolsas y mercados españoles). Revista sin ISSN. 189, pp. 70 - 82. (España): 2011. ISSN 0000-0000  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 1
- 22** Nieto, B.; Rubio, G. The volatility of consumption-based stochastic discount factors and economic cycles. Journal of Banking and Finance. 35/9, pp. 2197 - 2216. (Holanda): 2011. ISSN 0378-4266  
**DOI:** 10.1016/j.bankfin.2011.01.021  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 23** Nieto, B.; Novales, A.; Rubio, G. Variance swaps and intertemporal asset pricing. The Spanish Review of Financial Economics. 9/1, pp. 20 - 30. 2011. ISSN 2173-1268  
**DOI:** 10.1016/j.srfe.2011.01.001  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 3
- 24** Lopez, G.; Marhuenda, J.; Nieto, B. The relationship between risk and expected returns with incomplete information. Investigaciones Economicas. XXXIII/1, pp. 69 - 96. (España): 2009. ISSN 0210-1521  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 3  
**Nº total de autores:** 3
- 25** Nieto, B. Preferencias y valoración de activos: Un panorama sobre la persistencia de hábitos. Revista de Economía Financiera. 11, pp. 87 - 112. (España): 2007. ISSN 1697-9761  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 1
- 26** Nieto, B.; Rodríguez, R. The consumption/wealth and book/market ratios in a dynamic asset pricing context. Spanish Economic Review. 8/3, pp. 199 - 226. 2006. ISSN 1435-5469  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2



- 27** Martínez, M. A.; Nieto, B.; Rubio, G.; Tapia, M. Asset pricing and systematic liquidity risk: An empirical investigation of the Spanish stock market. *International Review of Economics and Finance*. 14/1, pp. 81 - 103. (Holanda): 2005. ISSN 1059-0560  
**DOI:** 10.1016/j.iref.2003.12.001  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 2  
**Nº total de autores:** 4
- 28** Nieto, B.; Rodríguez, R. Modelos de valoración de activos condicionales: Un panorama comparativo. *Investigaciones Economicas*. XXIX/1, pp. 33 - 71. (España): 2005. ISSN 0210-1521  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 29** Nieto, B. Evaluating multi-beta pricing models: An empirical analysis with Spanish market data. *Revista de Economía Financiera*. 2, pp. 80 - 108. (España): 2004. ISSN 1697-9761  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 1
- 30** Nieto, B.; Rubio, G. El modelo de valoración con cartera de mercado: Una nueva especificación del coeficiente beta. *REVISTA ESPAÑOLA DE FINANCIACION Y CONTABILIDAD SPANISH JOURNAL OF FINANCE AND ACCOUNTING*. XXXI/113, pp. 697 - 723. 2002. ISSN 0210-2412  
**DOI:** 10.1080/02102412.2002.10779459  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 2
- 31** Nieto, B. La valoración intertemporal de activos: un análisis empírico para el mercado español de valores. *Investigaciones Economicas*. XXVI/3, pp. 497 - 524. (España): 2002. ISSN 0210-1521  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 1
- 32** Abad, D.; Marhuenda, J.; Nieto, B. Anomalías en el Mercado Español de Capitales. Un nuevo Enfoque: Dominancia Estocástica. *Moneda y Crédito*. 211, pp. 183 - 200. (España): 2000. ISSN 0026-959X  
**Tipo de producción:** Artículo científico **Tipo de soporte:** Revista  
**Posición de firma:** 3  
**Nº total de autores:** 3
- 33** Nieto, B. Fondos y sociedades de inversión. Curso de experto profesional en asesoramiento financiero. (España): Editorial Santillana, 2007. ISBN 84-690-2390-X  
**Tipo de producción:** Capítulo de libro **Tipo de soporte:** Libro  
**Posición de firma:** 1  
**Nº total de autores:** 1