



CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO



Íñigo Arregui Álvarez

Generado desde: Editor CVN de FECYT

Fecha del documento: 28/11/2025

v 1.4.3

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

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/>



Resumen libre del currículum

Descripción breve de la trayectoria científica, los principales logros científico-técnicos obtenidos, los intereses y objetivos científico-técnicos a medio/largo plazo de la línea de investigación. Incluye también otros aspectos o peculiaridades importantes.

I am Mining Engineer (U. Politécnica de Madrid, 1989) and Doctor from École Centrale de Paris (1994). Since 1996 I am associate professor in applied mathematics at Universidade da Coruña. I have previously been Attaché Temporaire en Enseignement et Recherche at Conservatoire National des Arts et Métiers (Paris, France, 1993/94) and professor at Universidad Alfonso X El Sabio de Madrid (1994/1996).

My research lines are the modeling and numerical simulation of industrial processes; in particular, some problems concerning shell structures, lubrication and couplings of both (elastohydrodynamic lubrication). In the last years, I have also faced some problems of financial mathematics concerning optimal investments, transactions costs and the valuing of different products in the presence of counterparty risk. In all cases, the problems are governed by (nonlinear) partial differential equations; their numerical resolution and simulation is carried on by advanced techniques related to the finite element method.

Moreover, I have also occupied different academic positions related to University management: secretary of the Faculty of Informatics (1999-2005 and 2013-2017), secretary of the Mathematics Department (2005-2008) and head of the Mathematics Department (2008-2012). I have also been the treasurer of the Spanish Society of Applied Mathematics (2007-2010).



Indicadores generales de calidad de la producción científica

Información sobre el número de sexenios de investigación y la fecha del último concedido, número de tesis doctorales dirigidas en los últimos 10 años, citas totales, promedio de citas/año durante los últimos 5 años (sin incluir el año actual), publicaciones totales en primer cuartil (Q1), índice h. Incluye otros indicadores considerados de importancia.

I have four six-years research periods (recognized by the Spanish Research Agency), the last one finishing in 2021. I have supervised three doctoral theses and I am currently supervising one new thesis. I am the author of around twenty five papers (all of them are indexed in JCR) and around thirty communications in national and international conferences.

Following Google Scholar, my papers have been cited 237 times and my h-index is 9.



Íñigo Arregui Álvarez

Apellidos: Arregui Álvarez
Nombre: Íñigo
ORCID: 0000-0002-2456-4092
ScopusID: 57196839648
ResearcherID: AAB-4239-2019
Página web personal: dm.udc.es/staff/arregui

Situación profesional actual

Entidad empleadora: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Categoría profesional: Profesor Titular de Universidad

Fecha de inicio: 04/11/1998

Modalidad de contrato: Funcionario/a

Régimen de dedicación: Tiempo completo

Cargos y actividades desempeñados con anterioridad

	Entidad empleadora	Categoría profesional	Fecha de inicio
1	Universidad de La Coruña	Profesor Titular de Universidad (interino)	04/11/1996
2	Universidad Alfonso X El Sabio	Profesor Titular Doctor	01/09/1994
3	Conservatoire National des Arts et Métiers	Attaché Temporaire Enseignement et Recherche	01/10/1993

1 Entidad empleadora: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Departamento: Matemáticas

Ciudad entidad empleadora: A Coruña, Galicia, España

Categoría profesional: Profesor Titular de Universidad (interino)

Fecha de inicio-fin: 04/11/1996 - 03/11/1998

Modalidad de contrato: Interino/a

2 Entidad empleadora: Universidad Alfonso X El Sabio **Tipo de entidad:** Universidad

Categoría profesional: Profesor Titular Doctor

Fecha de inicio-fin: 01/09/1994 - 31/10/1996

3 Entidad empleadora: Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e Investigación

Categoría profesional: Attaché Temporaire Enseignement et Recherche

Fecha de inicio-fin: 01/10/1993 - 31/08/1994



Resumen de la actividad profesional

Soy profesor titular de universidad en la Universidad de La Coruña desde 1998, siempre en el área de Matemática Aplicada. He conseguido la evaluación positiva de cinco quinquenios (1996-2021).



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: Ingeniero de Minas

Entidad de titulación: Universidad Politécnica de Madrid **Tipo de entidad:** Universidad

Fecha de titulación: 06/10/1989

Doctorados

1 Programa de doctorado: Simulación numérica de fenómenos físicos y técnicos

Entidad de titulación: Universidad Politécnica de Madrid **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad titulación: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Fecha de titulación: 06/02/1996

Director/a de tesis: Philippe Destuynder

Calificación obtenida: Apto cum laude

2 Entidad de titulación: École Centrale de Paris **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad titulación: Francia

Fecha de titulación: 28/02/1994

Título de la tesis: Une technique eulérienne pour la simulation des coques minces en grands déplacements

Director/a de tesis: Philippe Destuynder

Calificación obtenida: Très honorable avec félicitations

Conocimiento de idiomas

Idioma	Comprensión auditiva	Comprensión de lectura	Interacción oral	Expresión oral	Expresión escrita
Francés					
Inglés					



C

V

N

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

Actividad docente

Formación académica impartida

1 Tipo de docencia: Docencia oficial

Nombre de la asignatura/curso: Modelos matemáticos en mecánica de medios continuos

Tipo de programa: Máster oficial

Tipo de docencia: Teórica presencial

Tipo de asignatura: Obligatoria

Titulación universitaria: Máster en Ingeniería Matemática

Curso que se imparte: 1

Fecha de inicio: 01/10/2006

Fecha de finalización: 31/07/2013

Tipo de horas/créditos ECTS: Créditos

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Idioma de la asignatura: Español

2 Tipo de docencia: Docencia oficial

Nombre de la asignatura/curso: Modelos matemáticos en mecánica de medios continuos

Tipo de programa: Doctorado/a

Tipo de docencia: Teórica presencial

Tipo de asignatura: Obligatoria

Titulación universitaria: Modelos matemáticos y métodos numéricos en ingeniería y ciencias aplicadas

Fecha de inicio: 01/10/2003

Fecha de finalización: 30/09/2006

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Idioma de la asignatura: Español

3 Tipo de docencia: Docencia oficial

Nombre de la asignatura/curso: Métodos Numéricos para la Informática

Tipo de programa: Grado

Tipo de docencia: Teórica presencial

Tipo de asignatura: Optativa

Titulación universitaria: Grado en Ingeniería Informática

Curso que se imparte: 4

Fecha de inicio: 01/09/2014

Tipo de horas/créditos ECTS: Créditos

Nº de horas/créditos ECTS: 6

Entidad de realización: Universidade da Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Facultad, instituto, centro: Facultad de Informática

4 Tipo de docencia: Docencia oficial

Nombre de la asignatura/curso: Mecánica de medios continuos

Tipo de programa: Máster oficial

Tipo de docencia: Teórica presencial

Tipo de asignatura: Optativa

Titulación universitaria: Máster en Matemática Industrial

Curso que se imparte: 1

Fecha de inicio: 01/09/2013

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España



Idioma de la asignatura: Español

5 **Tipo de docencia:** Docencia oficial

Nombre de la asignatura/curso: Taller de problemas industriales

Tipo de programa: Máster oficial

Tipo de docencia: Práctica (Aula-Problemas)

Tipo de asignatura: Obligatoria

Titulación universitaria: Máster en Matemática Industrial

Tipo de horas/créditos ECTS: Créditos

Nº de horas/créditos ECTS: 1

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Idioma de la asignatura: Español

Dirección de tesis doctorales y/o trabajos fin de estudios

1 **Título del trabajo:** Calibración del modelo de volatilidad local estocástica con métodos de partículas

Tipo de proyecto: Trabajo fin de máster

Entidad de realización: Universidad Carlos III de

Tipo de entidad: Universidad

Madrid

Ciudad entidad realización: Leganés,

Alumno/a: Diego Robisco González

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.9)

Fecha de defensa: 11/07/2025

2 **Título del trabajo:** Interpolación de datos entre mallas refinadas mediante técnicas spline

Tipo de proyecto: Trabajo fin de grado

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Mateo Ramos Rega

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.0)

Fecha de defensa: 03/07/2025

3 **Título del trabajo:** Estudio de metodologías de cálculo de identificabilidad y observabilidad

Tipo de proyecto: Trabajo fin de máster

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Dorin Alexandru Ionescu Leoca

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 05/02/2025

4 **Título del trabajo:** Calibración a mercado de la función de volatilidad ajustada

Tipo de proyecto: Trabajo fin de máster

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: La Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Alejandro Aneiros Batista

Calificación obtenida: Notable (8.5)

Fecha de defensa: 07/02/2024

5 **Título del trabajo:** Simulaciones de soldadura en ANSYS Workbench

Tipo de proyecto: Trabajo fin de máster

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad



Ciudad entidad realización: Galicia, España

Alumno/a: Manuel Oliva Arrojo

Fecha de defensa: 15/09/2023

6 Título del trabajo: Mathematical models and numerical methods for XVA in multi-currency setting

Tipo de proyecto: Tesis Doctoral

Codirector/a tesis: Carlos Vázquez Cendón

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Roberta Simonella

Calificación obtenida: Sobresaliente cum laude

Fecha de defensa: 14/07/2023

Doctorado Europeo / Internacional: Sí

7 Título del trabajo: Método de elementos finitos de alto orden para la valoración de productos financieros

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Martín Zapata Martínez

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.0)

Fecha de defensa: 17/02/2023

8 Título del trabajo: Implementación de modelos de predicción del precio de la electricidad en el mercado a plazo

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade da Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Pedro Siaba Rodríguez

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.5)

Fecha de defensa: 27/09/2022

9 Título del trabajo: Volatilidad local vs volatilidad estocástica. Cuantificación del riesgo de modelo

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Jacobo Santos Fernández

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.0)

Fecha de defensa: 24/09/2021

10 Título del trabajo: Desarrollo de una calculadora de Valor en Riesgo (VaR) basada en simulación histórica

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Shiqi Zou

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.0)

Fecha de defensa: 15/07/2021

11 Título del trabajo: Técnicas de aprendizaje profundo y su aplicación a la valoración de seguros para vuelo de drones

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Alberto Conde Iglesias

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.4)

Fecha de defensa: 25/09/2020



12 **Título del trabajo:** Una técnica de deep learning para resolver modelos de valoración de derivados basados en EDPs

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de Santiago de Compostela **Tipo de entidad:** Universidad

Alumno/a: Yaiza Santiago Vega

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.6)

Fecha de defensa: 25/09/2020

13 **Título del trabajo:** Desarrollo de un simulador Monte Carlo y su aplicación al cálculo del VaR

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de Santiago de Compostela **Tipo de entidad:** Universidad

Alumno/a: Miguel Nóvoa Lorenzo

Calificación obtenida: Notable (8.0)

Fecha de defensa: 17/07/2020

14 **Título del trabajo:** DNS of bubble swarms using an Eulerian–Lagrangian method. Turbulence length scale and spectral energy transfer

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Ernesto Rama Novo

Calificación obtenida: Notable

Fecha de defensa: 17/09/2019

15 **Título del trabajo:** Simulación numérica de algunos fenómenos relacionados con el fondeo de buques

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Alumno/a: Miguel Ángel Vilar Rodríguez

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.25)

Fecha de defensa: 17/09/2019

16 **Título del trabajo:** Modelling, mathematical analysis and numerical simulation of problems related to counterparty risk and CVA

Tipo de proyecto: Tesis Doctoral

Codirector/a tesis: Carlos Vázquez Cendón

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Beatriz Salvador Mancho

Calificación obtenida: Sobresaliente cum laude

Fecha de defensa: 17/12/2018

Doctorado Europeo / Internacional: Sí

Fecha de mención: 17/12/2018

Mención de calidad: Sí

17 **Título del trabajo:** Modelo de volatilidad local estocástica para la valoración de opciones FX-TARN

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Jonatan Ráfales Pérez

Calificación obtenida: Sobresaliente (10.0)



Fecha de defensa: 17/07/2018

18 **Título del trabajo:** Valoración de opciones asiáticas con métodos de volatilidad local estocástica

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: Santiago de Compostela, Galicia, España

Alumno/a: Daniel Hugo Heinisch Rodicio

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.0)

Fecha de defensa: 13/07/2017

19 **Título del trabajo:** Aplicación web para la gestión de asistencia a reuniones en un centro universitario

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Codirector/a tesis: Susana Ladra González

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Diego Sánchez Lamas

Calificación obtenida: Notable (8.3)

Fecha de defensa: 29/06/2017

20 **Título del trabajo:** Low-Rank Reconstruction in Non-Uniform Sampling NMR

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: Santiago de Compostela, Galicia, España

Alumno/a: David Orive Miguel

Calificación obtenida: Sobresaliente (10.0)

Fecha de defensa: 18/07/2016

21 **Título del trabajo:** Cálculo del CVA mediante modelos de ecuaciones en derivadas parciales

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidade de Santiago de Compostela **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: Santiago de Compostela, Galicia, España

Alumno/a: Beatriz Salvador Mancho

Calificación obtenida: Sobresaliente (10.0)

Fecha de defensa: 20/07/2015

22 **Título del trabajo:** Simulación numérica de un modelo de optimización de inversiones con costes de transacción y consumo

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Codirector/a tesis: Carlos Vázquez Cendón

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Brais Amo Seco

Calificación obtenida: Notable (8.5)

Fecha de defensa: 30/06/2015

23 **Título del trabajo:** Modelo de optimización de inversiones en presencia de costes de transacción: resolución numérica y aplicación informática

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera



Codirector/a tesis: Carlos Vázquez Cendón

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Natalia Fernández Monterroso

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 10/07/2012

24 Título del trabajo: Optimización mediante métodos multimalla de un código de difusión anisotrópica

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de Vigo

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: Vigo, Galicia, España

Alumno/a: Roi Méndez Rial

Calificación obtenida: Sobresaliente (9.5)

Fecha de defensa: 17/07/2009

25 Título del trabajo: Método adaptativo de elementos finitos. Aplicación a la reducción de ruido en imágenes fotográficas

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Marco Abad González

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 17/07/2008

26 Título del trabajo: Programa de manipulación de curvas para su parametrización y posterior uso en programas de elementos finitos: correlación

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: José Amador Varela Martínez

Calificación obtenida: Sobresaliente (10.0)

Fecha de defensa: 15/07/2008

27 Título del trabajo: Simulación por elementos finitos de la ecuación no lineal de Perona–Malik y su aplicación al procesado de imágenes

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: María Belén Cerdeiras Pico

Calificación obtenida: Matrícula de Honor

Fecha de defensa: 11/10/2005

28 Título del trabajo: Refinamiento y desrefinamiento adaptativo de mallados

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Marco Abad González

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 14/07/2005



29 **Título del trabajo:** Estudio matemático y numérico del modelo de Reynolds-Koiter y de los modelos tribológicos en lectura magnética

Tipo de proyecto: Tesis Doctoral

Codirector/a tesis: Carlos Vázquez Cendón

Entidad de realización: Universidade de Vigo

Tipo de entidad: Universidad

Ciudad entidad realización: Vigo, Galicia, España

Alumno/a: J. Jesús Cendán Verdes

Calificación obtenida: Sobresaliente cum laude

Fecha de defensa: 08/07/2005

30 **Título del trabajo:** Aplicación de elementos finitos multimalla para la simulación numérica de problemas de convección-difusión

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Pablo Otero Díaz

Fecha de defensa: 09/10/2003

31 **Título del trabajo:** Refinamiento adaptativo de mallados: método de Bank

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: María Jesús López Otero

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 17/07/2003

32 **Título del trabajo:** Curso interactivo para la enseñanza del entorno Matlab

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: María Belén Cerdeiras Pico

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 11/10/2002

33 **Título del trabajo:** Métodos de descenso para grandes sistemas lineales de ecuaciones

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Vicente Vilar López

Calificación obtenida: Sobresaliente

Fecha de defensa: 07/09/1999

34 **Título del trabajo:** Tutorial de diferencias finitas para ecuaciones en derivadas parciales hiperbólicas con salida gráfica

Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Alumno/a: Ana Belén Loureiro Rodríguez

Calificación obtenida: Notable

Fecha de defensa: 08/10/1998



- 35** **Título del trabajo:** Développement et validation d'un algorithme de plasticité pour les coques minces
Tipo de proyecto: Proyecto Final de Carrera
Entidad de realización: Conservatoire National des Arts **Tipo de entidad:** Universidad et Métiers
Ciudad entidad realización: Paris, Île de France, Francia
Alumno/a: Didier Nurdin
Calificación obtenida: Très bien
Fecha de defensa: 28/09/1994

Proyectos de innovación docente

- Título del proyecto:** Grupo de innovación docente en modelización matemática y simulación numérica
Tipo de participación: Miembro de equipo
Tipo duración relación laboral: De duración indeterminada o indefinida
Entidad financiadora: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad
Fecha de inicio: 2022

Experiencia científica y tecnológica

Grupos/equipos de investigación, desarrollo o innovación

- Nombre del grupo:** Modelos y métodos numéricos en ingeniería y ciencias aplicadas
Objeto del grupo: Investigación y desarrollo
Código normalizado: M2NICA
Entidad de afiliación: Universidad de La Coruña
Fecha de inicio: 01/01/1997
Clase de colaboración: Coautoría de publicaciones
Tipo de entidad: Universidad

Actividad científica o tecnológica

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

- 1** **Nombre del proyecto:** Métodos matemáticos y simulación numérica en economía y finanzas cuantitativas, biotecnología, medioambiente e ingeniería
Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad
Ciudad entidad realización: La Coruña, Galicia, España
Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón
Nº de investigadores/as: 9
Entidad/es financiadora/s:
Ministerio de Ciencia e Innovación **Tipo de entidad:** Gobierno central
Fecha de inicio-fin: 01/01/2023 - 31/12/2025

- 2** **Nombre del proyecto:** ABC-EU-XVA
Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional **Ámbito geográfico:** Unión Europea

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Cornelis W. Oosterlee; Andrea Pascucci; Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Unión Europea

Tipo de entidad: Unión Europea

Tipo de participación: Miembro de equipo

Nombre del programa: Horizon 2020

Fecha de inicio-fin: 01/01/2019 - 31/12/2023

Entidad/es participante/s: Abanca; Analistas Financieros Internacionales, S.A.; BANCO SANTANDER, S.A.; CWI; Ernst and Young; Unipol; Universidad de Delft; Universidad de La Coruña; Università de Bologna

3 **Nombre del proyecto:** Métodos matemáticos y computacionales para nuevos retos en finanzas cuantitativas, medioambiente, biotecnología e ingeniería

Ámbito geográfico: Nacional

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Entidad/es financiadora/s:

Ministerio de Ciencia e Innovación

Tipo de entidad: Gobierno central

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: PID2019-108584RB-I00

Fecha de inicio-fin: 01/01/2020 - 31/12/2022

Régimen de dedicación: Tiempo completo

4 **Nombre del proyecto:** Ayudas para la consolidación y estructuración de unidades de investigación competitivas (GRC)

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Fecha de inicio-fin: 01/01/2019 - 31/12/2021

Duración: 3 años

5 **Nombre del proyecto:** Modelos matemáticos y simulación numérica para retos en finanzas cuantitativas, medioambiente, biotecnología y eficiencia industrial

Modalidad de proyecto: De investigación fundamental (incluyendo excavaciones arqueológicas, etc.).

Ámbito geográfico: Nacional

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Ministerio de Economía y Competitividad

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: MTM2016-76497-R

Fecha de inicio-fin: 01/01/2017 - 31/12/2019

Régimen de dedicación: Tiempo completo



6 **Nombre del proyecto:** Ayudas para la acreditación, estructuración y mejora de centros de investigación singulares y agrupaciones estratégicas consolidadas del Sistema universitario de Galicia, cofinanciadas por el Fondo Europeo de Desarrollo Regional (FEDER) en el marco del programa operativo FEDER Galicia 2014-2020

Entidad de realización: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad realización: A Coruña, Galicia, España

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Manuel González Penedo

Entidad/es financiadora/s:

Fondo Europeo de Desarrollo Regional

Tipo de entidad: Unión Europea

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Fecha de inicio-fin: 01/01/2016 - 30/11/2019

Cuantía total: 1.785.000 €

7 **Nombre del proyecto:** WakeUpCall

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Unión Europea

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Cornelis W. Oosterlee; Andrea Pascucci; Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Unión Europea

Tipo de entidad: Unión Europea

Tipo de participación: Miembro de equipo

Nombre del programa: Horizon 2020

Cód. según financiadora: HORIZON2020-MCSA-ITN-2014-EID (643045)

Fecha de inicio-fin: 01/01/2015 - 31/12/2018

8 **Nombre del proyecto:** Modelado matemático, análisis y simulación numérica de problemas en finanzas y seguros, procesos industriales, biotecnología y medio ambiente

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Nacional

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Ministerio de Economía y Competitividad

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Tipo de participación: Miembro de equipo

Fecha de inicio-fin: 01/01/2014 - 31/12/2016

Régimen de dedicación: Tiempo completo

9 **Nombre del proyecto:** Ayuda para consolidación y estructuración de unidades de investigación competitiva, modalidad de grupos de referencia competitiva por su actividad investigadora

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA



C

V

N

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: CN2011/004

Fecha de inicio-fin: 01/01/2011 - 31/12/2013

10 Nombre del proyecto: Modelos, análisis matemático y resolución numérica de algunos problemas en ciencias e ingenier??a basados en EDP's

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Nacional

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Ministerio de Ciencia e Innovación

Tipo de entidad: Ministerio

Ciudad entidad financiadora: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: MTM2010-21135-C02-01

Fecha de inicio-fin: 01/01/2011 - 31/12/2013

11 Nombre del proyecto: Modelado matemático y simulación numérica de procesos en finanzas cuantitativas y mecánica

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: INCITE09-105-339-PR

Fecha de inicio-fin: 01/11/2009 - 31/10/2012

12 Nombre del proyecto: Red MATHEMATICA Computing and Consulting de Galicia

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Wenceslao González Manteiga

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Fecha de inicio-fin: 01/01/2009 - 31/12/2010

13 Nombre del proyecto: Red Gallega de Cálculo de Altas Prestaciones

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Ramón Doallo Biempica

**C****V****N**

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España**Tipo de participación:** Miembro de equipo**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2008 - 31/12/2010**14 Nombre del proyecto:** Métodos matemáticos y numéricos para modelos de ecuaciones en derivadas parciales no lineales y acopladas en finanzas, mecánica y medio ambiente**Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Carlos Vázquez Cendón**Entidad/es financiadora/s:**

MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA

Ciudad entidad financiadora: España**Tipo de participación:** Miembro de equipo**Fecha de inicio-fin:** 01/12/2007 - 30/11/2010**15 Nombre del proyecto:** Stratégies de jeux et calcul scientifique en optimisation multidisciplinaire**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** A. Habbal; R. Aboulaïch; P. Bagnerini; M. Moakher; Carlos Vázquez Cendón**Entidad/es financiadora/s:**

Ministère de l'Enseignement Supérieur et de la Recherche Scientifique (Argelia)

CIRAD

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Centre National de la Recherche Scientifique et Technique (Marruecos)

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Instituto de Recursos Naturales y Agrobiología de Salamanca

Tipo de entidad: Agencia Estatal

INRIA

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Ministère de l'Enseignement Supérieur, de la Recherche Scientifique et de la Technologie (Túnez)

Tipo de entidad: Agencia Estatal**Tipo de participación:** Miembro de equipo**Nombre del programa:** Programme EuroMéditerranée 3+3**Fecha de inicio-fin:** 01/06/2009 - 31/05/2010**16 Nombre del proyecto:** Modelos matemáticos y métodos numéricos de EDP's en finanzas cuantitativas mecánica y medioambiente**Ámbito geográfico:** Autonómica**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Carlos Vázquez Cendón**Entidad/es financiadora/s:**

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España**Tipo de participación:** Miembro de equipo



Cód. según financiadora: PGIDIT06-PXIB-105230-PR

Fecha de inicio-fin: 01/12/2006 - 30/11/2009

17 Nombre del proyecto: Red MATHEMATICA Computing and Consulting de Galicia

Ámbito geográfico: Autonómica

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Wenceslao González Manteiga

Entidad/es financiadora/s:

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: 95/2006

Fecha de inicio-fin: 01/01/2006 - 31/12/2008

18 Nombre del proyecto: Análisis matemático y numérico de modelos térmicos, mecánicos e hidrodinámicos acoplados: aplicaciones en combustión, glaciolog??a y tribolog??a

Ámbito geográfico: Nacional

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Entidad/es financiadora/s:

MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: MTM2004-05796-C02-01

Fecha de inicio-fin: 01/01/2005 - 31/12/2007

19 Nombre del proyecto: Modelos acoplados termomecánicos y termohidrodinámicos en Glaciolog??a y Tribolog??a

Ámbito geográfico: Nacional

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:

Ministerio de Ciencia y Tecnología

Tipo de entidad: Agencia Estatal

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España

Tipo de participación: Miembro de equipo

Cód. según financiadora: BFM2001-3261-C02-02 / PGIDIT-02-PXIC-10503-PN

Fecha de inicio-fin: 01/01/2002 - 31/12/2004

20 Nombre del proyecto: Análisis matemático y numérico de los efectos elásticos en modelos hidrodinámicos en tribolog??a

Modalidad de proyecto: De investigación y desarrollo incluida traslacional

Ámbito geográfico: Unión Europea

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Vázquez Cendón

Entidad/es financiadora/s:



C

V

N

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

Ministerio de Ciencia y Tecnología**Tipo de entidad:** Agencia Estatal**Embajada de Francia en España****Tipo de entidad:** Embajada**Ciudad entidad financiadora:** Madrid, Comunidad de Madrid, España**Tipo de participación:** Miembro de equipo**Cód. según financiadora:** HF 2000-001**Fecha de inicio-fin:** 01/01/2001 - 31/12/2002**21 Nombre del proyecto:** Problemas acoplados en lubricación elastohidrodinámica: modelado y simulación numérica de grandes desplazamientos en el dispositivo eje-cojinete**Modalidad de proyecto:** De investigación y desarrollo incluida traslacional **Ámbito geográfico:** Universidad**Grado de contribución:** Coordinador/a científico/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Iñigo Arregui**Nº de investigadores/as:** 3**Entidad/es financiadora/s:**Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Ciudad entidad financiadora:** A Coruña, Galicia, España**Tipo de participación:** Investigador principal**Fecha de inicio-fin:** 01/01/1999 - 31/12/2000**22 Nombre del proyecto:** Estudio matemático y numérico de problemas acoplados con fronteras libres. Aplicaciones a la glaciología y a la tribología**Modalidad de proyecto:** De investigación y desarrollo incluida traslacional **Ámbito geográfico:** Nacional**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Carlos Vázquez Cendón**Entidad/es financiadora/s:**

MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA

Ciudad entidad financiadora: España

XUNTA DE GALICIA

Ciudad entidad financiadora: España**Tipo de participación:** Investigador principal**Cód. según financiadora:** PB96 - 0341 - C02 - 02 / XUGA 32201B97**Fecha de inicio-fin:** 01/11/1997 - 31/10/2000**23 Nombre del proyecto:** Modelización y simulación numérica de diversos acoplamientos elastohidrodinámicos en capas finas de fluido**Grado de contribución:** Investigador/a**Entidad de realización:** Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad**Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...):** Carlos Vázquez Cendón**Entidad/es financiadora/s:**Embajada de Francia en España **Tipo de entidad:** Embajada**Ciudad entidad financiadora:** Madrid, Comunidad de Madrid, España

MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA

Ciudad entidad financiadora: España**Tipo de participación:** Miembro de equipo



Cód. según financiadora: HF1997 - 0121
Fecha de inicio-fin: 01/01/1998 - 31/12/1999

Contratos, convenios o proyectos de I+D+i no competitivos con Administraciones o entidades públicas o privadas

1 Nombre del proyecto: Curso sobre programación científica con Python

Grado de contribución: Coordinador/a científico/a

Ciudad entidad realización: Santander, Cantabria, España

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Iñigo Arregui

Nº de investigadores/as: 2

Entidad/es participante/s: BSH Electrodomésticos España, S.A.; Red Española Matemática Industria Math-in; Universidade da Coruña

Entidad/es financiadora/s:

BSH Electrodomésticos España, S.A.

Tipo de entidad: Entidad Empresarial

Ciudad entidad financiadora: Zaragoza, Aragón, España

Fecha de inicio: 30/05/2017

Duración: 3 días

Cuantía total: 4.897,7 €

2 Nombre del proyecto: Utilisation des techniques de maillages adaptatifs pour la simulation numérique de l'emboutissage

Modalidad de proyecto: De investigación fundamental (incluyendo excavaciones arqueológicas, etc.).

Entidad de realización: Conservatoire National des Arts et Métiers

Grado de contribución: Investigador/a

Entidad de realización: Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e Investigación

Ciudad entidad realización: Francia

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Philippe Destuynder

Nº de investigadores/as: 3

Entidad/es participante/s: Conservatoire National des Arts et Métiers

Entidad/es financiadora/s:

Régie Nationale des Usines Renault

Tipo de entidad: Entidad Empresarial

Ciudad entidad financiadora: Francia

Fecha de inicio: 01/09/1990

Duración: 2 años

3 Nombre del proyecto: Desarrollo de un banco de Programas Informáticos para la Modelización de Procesos Relacionados con el Almacenamiento de Residuos Radiactivos

Entidad de realización: Universidad Politécnica de Madrid

Grado de contribución: Estudiante / Becario

Entidad de realización: Universidad Politécnica de Madrid **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad realización: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Nombres investigadores principales (IP, Co-IP,...): Carlos Conde Lázaro

Entidad/es financiadora/s:

Empresa Nacional de Residuos Radiactivos, S.A.

Tipo de entidad: Entidad Empresarial

Ciudad entidad financiadora: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Fecha de inicio: 01/01/1987

Duración: 2 años



Actividades científicas y tecnológicas

Producción científica

Publicaciones, documentos científicos y técnicos

- 1** Iñigo Arregui; Alejandro López Núñez; Carlos Vázquez Cendón. Pricing American real options with double continuation region under Heston model. *Applied Mathematics and Computation*. 513, Elsevier, 2026. ISSN 0096-3003
DOI: 10.1016/j.amc.2025.129810
Article Number: 129810
Tipo de producción: Artículo científico
Posición de firma: 1

Nº total de autores: 3
Publicación relevante: Sí
- Tipo de soporte:** Revista
Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo
Autor de correspondencia: No
- 2** Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez. Models and numerical methods for XVA pricing under mean reversion spreads in a multicurrency framework. *Communications in Nonlinear Science and Numerical Simulation*. 130 - Article Nr. 107725, 2024. ISSN 1007-5704
DOI: 10.1016/j.cnsns.2023.107725
Tipo de producción: Artículo científico
Posición de firma: 1

Nº total de autores: 3
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 3.400
Posición de publicación: 12

Publicación relevante: Sí
- Tipo de soporte:** Revista
Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo
Autor de correspondencia: No
Categoría: Applied Mathematics
Revista dentro del 25%: Sí
Num. revistas en cat.: 331
- 3** Iñigo Arregui; Mirco Martini; Roberta Simonella; Carlos Vázquez Cendón. Total value adjustment in a multi-currency framework with stochastic exchange rates and mean reversion spreads. *Journal of Computational Finance*. 29 - 1, pp. 37 - 75. (Reino Unido): 2025. ISSN 1755-2850
Tipo de producción: Artículo científico
Posición de firma: 1

Nº total de autores: 4
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 0,500
- Tipo de soporte:** Revista
Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo
Autor de correspondencia: No
Categoría: Social Sciences Edition - BUSINESS, FINANCE
Revista dentro del 25%: No
- 4** Iñigo Arregui; Álvaro Leitao; Beatriz Salvador; Carlos Vázquez Cendón. Efficient parallel Monte-Carlo techniques for pricing American options including counterparty credit risk. *International Journal of Computer Mathematics*. 101 - 8, pp. 821 - 841. Taylor and Francis, 2024. ISSN 0020-7160
DOI: 10.1080/00207160.2023.2172322
Tipo de producción: Artículo científico
Posición de firma: 1



Nº total de autores: 4

Fuente de impacto: WOS (JCR)

Índice de impacto: 1.700

Posición de publicación: 83

Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo

Categoría: Applied Mathematics

Revista dentro del 25%: No

Num. revistas en cat.: 331

5 Iñigo Arregui; José Jesús Cendán; María González Taboada. Numerical simulation of a time dependent lubrication problem arising in magnetic reading processes. *Discrete and Continuous Dynamical Systems, Series S*. 17 - 7, pp. 2436 - 2449. AIMS, 2024. ISSN 1937-1632

DOI: 10.3934/dcdss.2023083

Tipo de producción: Artículo científico

Posición de firma: 1

Nº total de autores: 3

Fuente de impacto: WOS (JCR)

Índice de impacto: 1.300

Posición de publicación: 124

Tipo de soporte: Revista

Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo

Autor de correspondencia: Sí

Categoría: Applied Mathematics

Revista dentro del 25%: No

Num. revistas en cat.: 331

6 Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez Cendón. Total value adjustment for European options in a multi-currency setting. *Applied Mathematics and Computation*. 413 - 126647, Elsevier, 2022. Disponible en Internet en: <<https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0096300321007311?via%3Dihub>>. ISSN 0096-3003

DOI: 10.1016/j.amc.2021.126647

Tipo de producción: Artículo científico

Posición de firma: 1

Nº total de autores: 3

Fuente de impacto: WOS (JCR)

Índice de impacto: 4.091 (2020)

Posición de publicación: 7

Tipo de soporte: Revista

Autor de correspondencia: No

Categoría: Applied Mathematics

Revista dentro del 25%: Sí

Num. revistas en cat.: 265

7 Iñigo Arregui; Jonatan Ráfales. A stochastic local volatility technique for TARN options. *International Journal of Computer Mathematics*. 97 - 5, pp. 1133 - 1149. 2020. ISSN 1029-0265

DOI: 10.1080/00207160.2019.1608357

Tipo de producción: Artículo científico

Posición de firma: 1

Nº total de autores: 2

Fuente de impacto: WOS (JCR)

Índice de impacto: 1.600 (2019)

Posición de publicación: 69

Tipo de soporte: Revista

Autor de correspondencia: Sí

Categoría: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED

Num. revistas en cat.: 260

8 Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Daniel Sevcovic; Carlos Vázquez Cendón. PDE models for American options with counterparty risk and two stochastic factors: mathematical analysis and numerical solution. *Computers and Mathematics with Applications*. 79 - 5, pp. 1525 - 1542. 2020. ISSN 0898-1221

DOI: 10.1016/j.camwa.2019.09.014

Tipo de producción: Artículo científico

Grado de contribución: Autor/a o coautor/a de artículo en revista con comité evaluador de admisión externo

Nº total de autores: 4

Fuente de impacto: WOS (JCR)

Índice de impacto: 3.370 (2019)

Tipo de soporte: Revista

Autor de correspondencia: No

Categoría: Applied Mathematics

Revista dentro del 25%: Sí

Posición de publicación: 8**Num. revistas en cat.: 260**

9 Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Carlos Vázquez. A Monte Carlo approach to American options pricing including counterparty risk. *International Journal of Computer Mathematics*. 96 - 11, pp. 2157 - 2176. 2019. ISSN 1029-0265
DOI: 10.1080/00207160.2018.1486399

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Autor de correspondencia:** Sí**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Índice de impacto:** 1,600 (2019)**Posición de publicación:** 69**Num. revistas en cat.: 260**

10 Iñigo Arregui; J. Jesús Cendán; María González. A local discontinuous Galerkin method for the compressible Reynolds lubrication equation. *Applied Mathematics and Computation*. 349, pp. 337 - 347. 2019. ISSN 0096-3003
DOI: 10.1016/j.amc.2018.12.060

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Autor de correspondencia:** No**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Índice de impacto:** 3.472 (2019)**Posición de publicación:** 7**Revista dentro del 25%:** Sí**Num. revistas en cat.: 260**

11 Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Daniel Sevcovic; Carlos Vázquez. Mathematical analysis of a nonlinear PDE model for European options with counterparty risk. *Comptes Rendus Mathématiques*. 357, pp. 252 - 257. 2019. ISSN 1631-073X
DOI: 10.1016/j.crma.2019.03.001

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Autor de correspondencia:** Sí**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Índice de impacto:** 0.719 (2019)**Posición de publicación:** 187**Revista dentro del 25%:** No**Num. revistas en cat.: 324**

12 Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Daniel Sevcovic; Carlos Vázquez. Total value adjustment for European options with two stochastic factors. Mathematical model, analysis and numerical simulation. *Computers and Mathematics with Applications*. 76, pp. 725 - 740. 2018. ISSN 0898-1221
DOI: 10.1016/j.camwa.2018.05.012

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Autor de correspondencia:** No**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Índice de impacto:** 2.811 (2018)**Posición de publicación:** 18**Revista dentro del 25%:** Sí**Num. revistas en cat.: 254**

13 Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Carlos Vázquez. A numerical strategy for telecommunications networks capacity planning under demand and price uncertainty. *Journal of Computational and Applied Mathematics*. 318, pp. 491 - 503. 2017. ISSN 0377-0427
DOI: 10.1016/j.cam.2016.01.056

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Autor de correspondencia:** Sí**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Índice de impacto:** 1.632 (2017)**Posición de publicación:** 49**Revista dentro del 25%:** Sí**Num. revistas en cat.: 252**



- 14** Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Carlos Vázquez. PDE models and numerical methods for total value adjustment in European and American options with counterparty risk. *Applied Mathematics and Computation*. 308, pp. 31 - 53. 2017. ISSN 0096-3003
DOI: 10.1016/j.amc.2017.03.008
Tipo de producción: Artículo científico
Autor de correspondencia: No
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 2.300 (2017)
Posición de publicación: 21
Tipo de soporte: Revista
Categoría: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: Sí
Num. revistas en cat.: 252
- 15** Iñigo Arregui; Carlos Vázquez. Evaluation of the optimal utility of some investment projects with irreversible environmental effects. *Pure and Applied Geophysics*. 172, pp. 149 - 165. 2015. ISSN 1420-9136
DOI: 10.1007/s00024-014-0900-1
Tipo de producción: Artículo científico
Autor de correspondencia: Sí
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 1.677 (2015)
Posición de publicación: 40
Tipo de soporte: Revista
Categoría: Science Edition - GEOCHEMISTRY & GEOPHYSICS
Revista dentro del 25%: No
Num. revistas en cat.: 81
- 16** Iñigo Arregui; J. Ildefonso Díaz; Carlos Vázquez. A nonlinear bilaplacian equation with hinged boundary conditions and very weak solutions: analysis and numerical solution. *Revista de la Real Academia de Ciencias Exactas, Físicas y Naturales. Serie A, Matemáticas*. 108 - 2, pp. 867 - 879. 2014. ISSN 1579-1505
DOI: 10.1007/s13398-013-0148-0
Tipo de producción: Artículo científico
Autor de correspondencia: No
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 0.776 (2014)
Posición de publicación: 95
Tipo de soporte: Revista
Categoría: Science Edition - MATHEMATICS
Num. revistas en cat.: 311
- 17** Iñigo Arregui; J. Jesús Cendán; Carlos Vázquez. Adaptive numerical methods for an hydrodynamic problem arising in magnetic reading devices. *Mathematics and Computers in Simulation*. 99, pp. 190 - 202. 2014. ISSN 0378-4754
DOI: 10.1016/j.matcom.2013.04.001
Tipo de producción: Artículo científico
Autor de correspondencia: No
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 0.949 (2014)
Posición de publicación: 97
Tipo de soporte: Revista
Categoría: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Num. revistas en cat.: 257
- 18** Iñigo Arregui; Carlos Vázquez. Numerical solution of an optimal investment problem with proportional transaction costs. *Journal of Computational and Applied Mathematics*. 236, pp. 2923 - 2937. 2012. ISSN 0377-0427
DOI: 10.1016/j.cam.2012.01.029
Tipo de producción: Artículo científico
Autor de correspondencia: Sí
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Índice de impacto: 0.989 (2012)
Posición de publicación: 79
Tipo de soporte: Revista
Categoría: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: No
Num. revistas en cat.: 247

- 19** Antonio Acci n; I igo Arregui; Carlos V zquez. Numerical solution of a free boundary problem associated to investments with instantaneous irreversible environmental effects. *Applied Mathematics and Computation*. 215, pp. 3461 - 3472. 2010. ISSN 0096-3003
DOI: 10.1016/j.amc.2009.10.042
Tipo de producci n: Artículo científico
Fuente de impacto: WOS (JCR)
 ndice de impacto: 1.536 (2010)
Posici n de publicaci n: 29
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: S 
Num. revistas en cat.: 236
- 20** I igo Arregui; J. Jes s Cend n; Carlos Par s; Carlos V zquez. Numerical solution of a 1-D elastohydrodynamic problem in magnetic storage devices. *Mathematical Modelling and Numerical Analysis*. 42, pp. 645 - 665. 2008. ISSN 0764-583X
DOI: 10.1051/m2an:2008021
Tipo de producci n: Artículo científico
Fuente de impacto: WOS (JCR)
 ndice de impacto: 0.978
Posici n de publicaci n: 57
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: No
Num. revistas en cat.: 175
- 21** I igo Arregui; J. Jes s Cend n; Carlos V zquez. Numerical simulation of head-tape magnetic reading devices by a new two dimensional model. *Finite Elements in Analysis and Design*. 43 - 4, pp. 311 - 320. 2007. ISSN 0168-874X
DOI: 10.1016/j.finel.2006.10.006
Tipo de producci n: Artículo científico
Fuente de impacto: WOS (JCR)
 ndice de impacto: 0.714
Posici n de publicaci n: 75
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Num. revistas en cat.: 165
- 22** I igo Arregui; J. Jes s Cend n; Carlos V zquez. A duality method for the compressible Reynolds equation. Application to simulation of read/write processes in magnetic storage devices. *Journal of Computational and Applied Mathematics*. 175, pp. 31 - 40. 2005. ISSN 0377-0427
DOI: 10.1016/j.cam.2005.06.00
Tipo de producci n: Artículo científico
Autor de correspondencia: S 
Fuente de impacto: WOS (JCR)
 ndice de impacto: 0.569
Posici n de publicaci n: 85
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: No
Num. revistas en cat.: 151
- 23** I igo Arregui; J. Jes s Cend n; Carlos V zquez. Mathematical Analysis and Numerical Simulation of a Reynolds-Koiter Model for the Elastohydrodynamic Journal-Bearing Device. *Mathematical Modelling and Numerical Analysis*. 36, pp. 325 - 344. 2002. ISSN 0764-583X
Tipo de producci n: Artículo científico
Fuente de impacto: WOS (JCR)
 ndice de impacto: 0.530
Posici n de publicaci n: 84
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS, APPLIED
Revista dentro del 25%: No
Num. revistas en cat.: 156
- 24** I igo Arregui; J. Jes s Cend n; Carlos V zquez. Existence of solution of an elastohydrodynamic Reynolds-Koiter model. *Comptes Rendus de l'Acad mie des Sciences de Paris, S rie I, Math matiques*. 333, pp. 1047 - 1052. 2001.
Tipo de producci n: Artículo científico
Fuente de impacto: WOS (JCR)
Tipo de soporte: Revista
Categor a: Science Edition - MATHEMATICS

**Índice de impacto:** 0.373**Posición de publicación:** 89**Num. revistas en cat.:** 161

- 25** Iñigo Arregui; Carlos Vázquez. Finite element solution of a Reynolds-Koiter coupled problem for the elastic journal-bearing. *Computer Methods in Applied Mechanics and Engineering*. 190, pp. 2051 - 2062. 2001.

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista

- 26** Iñigo Arregui; Philippe Destuynder; Michel Salaün. An Eulerian approach for large displacements of shells including geometrical non-linearities. *Computer Methods in Applied Mechanics and Engineering*. 140, pp. 361 - 381. 1997.

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista

- 27** Iñigo Arregui; Michel Salaün. Interpolation d'une surface déterminée par des noeuds et des normales. *Comptes Rendus de l'Académie des Sciences de Paris, Série I, Mathématiques*. 318, pp. 265 - 268. 1994.

Tipo de producción: Artículo científico**Tipo de soporte:** Revista**Fuente de impacto:** WOS (JCR)**Categoría:** Science Edition - MATHEMATICS**Índice de impacto:** 0.373**Posición de publicación:** 89**Num. revistas en cat.:** 161

- 28** Iñigo Arregui; J. Jesús Cendán; María González. Application of a local discontinuous Galerkin method to the 1d compressible Reynolds equation. *Recent Advances in Differential Equations and Applications*. pp. 63 - 75. Springer, 2019. ISBN 978-3-030-00340-1

Tipo de producción: Capítulo de libro**Tipo de soporte:** Libro

- 29** Iñigo Arregui; J. Jesús Cendán; Carlos Parés; Carlos Vázquez. Optimization of a duality method for the compressible Reynolds equation. *Numerical Mathematics and Advanced Applications*. pp. 319 - 327. Springer, 2006. ISBN 3-540-34287-7

Tipo de producción: Capítulo de libro**Tipo de soporte:** Libro

- 30** Iñigo Arregui; Philippe Destuynder; Michel Salaün. Continuous up-dating of a shell geometry in a non-linear analysis and applications to buckling simulation. *Continuous up-dating of a shell geometry in a non-linear analysis and applications to buckling simulation*. pp. 438 - 447. Walter de Gruyter & Co, 1995. ISBN 978-3-11-087372-6

Tipo de producción: Capítulo de libro**Tipo de soporte:** Libro

- 31** Iñigo Arregui; Philippe Destuynder; Michel Salaün. Mixed formulation for shells and mesh refinement. *Buckling of Shell Structures on Land, in the Sea and in the Air*. pp. 438 - 447. Elsevier Applied Science, 1991. ISBN 9781851667161

Tipo de producción: Capítulo de libro**Tipo de soporte:** Libro

- 32** Iñigo Arregui; Carlos Conde; Francisco Javier Elorza; María Jesús Miguel. A 1-D finite element characteristics code for the transport of radionuclides in porous media. *Computational Methods in Subsurface Hydrology*. pp. 289 - 298. Computational Mechanics Publications, 1990. ISBN 038752701X

Tipo de producción: Capítulo de libro**Tipo de soporte:** Libro**Autor de correspondencia:** No

- 33** Third International Conference on Computational Finance. Book of abstracts. A Coruña, Galicia(España): Servicio de Publicaciones de la Universidade da Coruña, 2019. Disponible en Internet en: <<https://ruc.udc.es/dspace/handle/2183/23188?locale-attribute=en>>. ISBN 978-84-9749-725-1

Tipo de producción: Libro o monografía científica**Tipo de soporte:** Libro**Posición de firma:** 1**Grado de contribución:** Editor/a o coeditor/a**Nº total de autores:** 3



- 34** Numerical Simulation in Physics and Engineering. Proceedings of the XIV Spanish–French Jacques–Louis Lions School. Servicio de Publicacións, Universidade da Coruña, 2010. ISBN 978-84-9749-420-5

Tipo de producción: Actas

Tipo de soporte: Libro

Trabajos presentados en congresos nacionales o internacionales

- 1** **Título del trabajo:** Models and numerical methods for XVA pricing in multicurrency derivative

Nombre del congreso: XXVIII Congreso de Ecuaciones Diferenciales y Aplicaciones / XVIII Congreso de Matemática Aplicada

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Nacional

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Bilbao, País Vasco, España

Fecha de celebración: 24/06/2024

Fecha de finalización: 28/06/2024

Entidad organizadora: Universidad del País Vasco **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad organizadora: Bilbao, País Vasco, España

Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez.

- 2** **Título del trabajo:** Pricing American options with endogeneous negative rates under Heston model

Nombre del congreso: XXVIII Congreso de Ecuaciones Diferenciales y Aplicaciones / XVIII Congreso de Matemática Aplicada

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Nacional

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Bilbao, País Vasco, España

Fecha de celebración: 24/06/2024

Fecha de finalización: 28/06/2024

Entidad organizadora: Universidad del País Vasco **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad organizadora: Bilbao, País Vasco, España

Iñigo Arregui; Alejandro López Núñez; Carlos Vázquez.

- 3** **Título del trabajo:** Stochastic modelling of rough surfaces in Tribology

Nombre del congreso: Emerging Trends in Applied Mathematics and Mechanics

Tipo evento: Congreso

Autor de correspondencia: Sí

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Fecha de celebración: 20/05/2024

Fecha de finalización: 24/05/2024

Entidad organizadora: Universidad de A Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad organizadora: A Coruña, Galicia, España

Forma de contribución: Libro o monografía científica

Iñigo Arregui; Carlos Vázquez. "Emerging Trends in Applied Mathematics and Mechanics". 2024.

DOI: <https://doi.org/10.17979/spudc.000028>

Handle: <http://hdl.handle.net/2183/36337>

- 4** **Título del trabajo:** XVA pricing under mean reversion spreads in a multicurrency framework

Nombre del congreso: V International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Intervención por: Acceso por inscripción libre



C

V

N

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: Sí

Ciudad de celebración: Amsterdam, Holanda

Fecha de celebración: 02/04/2024

Fecha de finalización: 05/04/2024

Entidad organizadora: Centrum Wiskunde
Informatica (CWI)

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad organizadora: Amsterdam, Holanda
Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez.

5 Título del trabajo: XVA Modelling and Computing in a Multicurrency Setting

Nombre del congreso: 21st IMACS 2023 World Congress

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Ponencia invitada / Keynote

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Roma, Italia

Fecha de celebración: 11/09/2023

Fecha de finalización: 15/09/2023

Entidad organizadora: International Association for Mathematics and Computers in Simulation

Ciudad entidad organizadora: Bruselas, Bélgica

Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez.

6 Título del trabajo: On the numerical solution of the compressible Reynolds equation

Nombre del congreso: Applied Mathematics for Engineering Sciences

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Plenaria

Intervención por: Por invitación

Autor de correspondencia: Sí

Ciudad de celebración: La Rochelle, Francia

Fecha de celebración: 23/06/2022

Fecha de finalización: 24/06/2022

Entidad organizadora: Université de La Rochelle

Ciudad entidad organizadora: La Rochelle, Francia

Forma de contribución: Artículo científico

Iñigo Arregui; J. Jesús Cendán; María González.

7 Título del trabajo: Modelling, mathematical analysis and numerical simulation of problems related to XVA

Nombre del congreso: V International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Plenaria

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Wuppertal, Alemania

Fecha de celebración: 06/06/2022

Fecha de finalización: 10/06/2022

Beatriz Salvador; Carlos Vázquez; Iñigo Arregui; Álvaro Leitao; Cornelis Oosterlee; Daniel Sevcovic.

8 Título del trabajo: Total value adjustment in a multi-currency setting with deterministic FX rates. Modelling and numerical computing

Nombre del congreso: IV International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)





Autor de correspondencia: Sí

Ciudad de celebración: Wuppertal, Alemania

Fecha de celebración: 06/06/2022

Fecha de finalización: 10/06/2022

Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez.

9 Título del trabajo: Pricing TARN options with a stochastic local volatility model

Nombre del congreso: XXVI Congreso de Ecuaciones Diferenciales y Aplicaciones / XVI Congreso de Matemática Aplicada

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Nacional

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Gijón, Principado de Asturias, España

Fecha de celebración: 14/06/2021

Fecha de finalización: 18/06/2021

Entidad organizadora: SOCIEDAD ESPAÑOLA DE MATEMATICA APLICADA

Ciudad entidad organizadora: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Iñigo Arregui; Jonatan Ráfales.

10 Título del trabajo: XVA for American options with two stochastic factors: modelling, mathematical analysis and numerical methods

Nombre del congreso: XXVI Congreso de Ecuaciones Diferenciales y Aplicaciones / XVI Congreso de Matemática Aplicada

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Nacional

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Gijón, Principado de Asturias, España

Fecha de celebración: 14/06/2021

Fecha de finalización: 18/06/2021

Entidad organizadora: SOCIEDAD ESPAÑOLA DE MATEMATICA APLICADA

Ciudad entidad organizadora: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Iñigo Arregui; Roberta Simonella; Carlos Vázquez.

11 Título del trabajo: PDE models for American options with total value adjustment and two stochastic factors

Nombre del congreso: Third International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Intervención por: Por invitación

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Fecha de celebración: 08/07/2019

Fecha de finalización: 12/07/2019

Entidad organizadora: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Ciudad entidad organizadora: A Coruña, Galicia, España

Publicación en acta congreso: Sí

Forma de contribución: Artículo científico

Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Daniel Sevcovic; Carlos Vázquez. En: Third International Conference on Computational Finance. Book of abstracts. Galicia (España): 2019. Disponible en Internet en: <<http://hdl.handle.net/2183/23188>>. ISBN 978-84-9749-725-1

Handle: <http://hdl.handle.net/2183/23188>



12 Título del trabajo: Total value adjustment for European options with two stochastic factors

Nombre del congreso: 16th International Conference of Numerical Analysis and Applied Mathematics (ICNAAM2018)

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Rodas, Grecia

Fecha de celebración: 13/09/2018

Fecha de finalización: 18/09/2018

Forma de contribución: Artículo científico

Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Daniel Sevcovic; Carlos Vázquez.

13 Título del trabajo: A stochastic local volatility technique for the valuation of TARN options

Nombre del congreso: International Conference of Computational Methods in Sciences and Engineering

Autor de correspondencia: Sí

Ciudad de celebración: Rota (Cádiz), Andalucía, España

Fecha de celebración: 09/07/2018

Fecha de finalización: 13/07/2018

Iñigo Arregui; Jonatan Ráfales.

14 Título del trabajo: PDE models and numerical methods for XVA in European and American options with stochastic intensities of default

Nombre del congreso: Second International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Tipo de participación: Participativo - Ponencia oral (comunicación oral)

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Lisboa, Lisboa, Portugal

Fecha de celebración: 04/09/2017

Fecha de finalización: 08/09/2017

Forma de contribución: Artículo científico

Iñigo Arregui; Beatriz Salvador; Carlos Vázquez.

15 Título del trabajo: PDE models for optimal investment under uncertainty with environmental effects

Nombre del congreso: Second International Conference on Computational Finance

Tipo evento: Congreso

Tipo de participación: Participativo - Plenaria

Intervención por: Por invitación

Autor de correspondencia: No

Ciudad de celebración: Lisboa, Lisboa, Portugal

Fecha de celebración: 04/09/2017

Fecha de finalización: 08/09/2017

Forma de contribución: Artículo científico

Iñigo Arregui; Carlos Vázquez.



Gestión de I+D+i y participación en comités científicos

Comités científicos, técnicos y/o asesores

1 Título del comité: Comité Científico del VII Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 17/10/2024 - 18/10/2024

2 Título del comité: Comité Científico del VI Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 05/10/2023 - 06/10/2023

3 Título del comité: Comité Científico del V Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 05/10/2022 - 06/10/2022

4 Título del comité: Comité Científico del IV Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 07/10/2021 - 08/10/2021

5 Título del comité: Comité Científico del XIV Foro Matemática Industria

Entidad de afiliación: Instituto Tecnológico de
Matemática Industrial

Tipo de entidad: Centro Tecnológico

Ciudad entidad afiliación: Santiago de Compostela, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 04/06/2021 - 04/06/2021

6 Título del comité: Comité Científico del III Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 08/10/2020 - 09/10/2020

7 Título del comité: Comité Científico del II Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 05/09/2019 - 06/09/2019

8 Título del comité: Comité Científico del I Congreso XoveTIC

Entidad de afiliación: CITIC

Tipo de entidad: Centro de I+D

Ciudad entidad afiliación: A Coruña, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 27/09/2018 - 28/09/2018

9 Título del comité: Comité Científico del XIII Foro Matemática Industria

Entidad de afiliación: Instituto Tecnológico de
Matemática Industrial

Tipo de entidad: Centro Tecnológico



Ciudad entidad afiliación: Santiago de Compostela, Galicia, España
Fecha de inicio-fin: 08/06/2018 - 08/06/2018

Organización de actividades de I+D+

1 Título de la actividad: Comité Organizador del XIV Foro Matemática Industria

Ámbito geográfico: Nacional

Entidad convocante: Instituto Tecnológico de
Matemática Industrial

Tipo de entidad: Instituto Universitario de
Investigación

Ciudad entidad convocante: Santiago de Compostela, Galicia, España

Fecha de inicio-fin: 04/06/2021 - 04/06/2021

Duración: 1 día

2 Título de la actividad: 3rd International Conference on Computational Finance

Tipo de actividad: Congreso internacional

Ámbito geográfico: Internacional no UE

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Modo de participación: Presidente

Fecha de inicio-fin: 08/07/2019 - 12/07/2019

Duración: 5 días

3 Título de la actividad: Summer School on Quantitative Methods for Risk Management in Finance and Insurance

Ámbito geográfico: Unión Europea

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Modo de participación: Organizador

Nº de asistentes: 30

Fecha de inicio-fin: 27/06/2016 - 01/07/2016

Duración: 5 días

4 Título de la actividad: XIV Escuela Hispano-Francesa Jacques-Louis Lions sobre Simulación Numérica en Física e Ingeniería

Ámbito geográfico: Nacional

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Modo de participación: Secretario/a

Nº de asistentes: 85

Fecha de inicio-fin: 06/09/2010 - 10/09/2010

Duración: 5 días

5 Título de la actividad: International Workshop on Modelling and Numerical Methods in Lubrication Technologies

Tipo de actividad: Workshop

Ámbito geográfico: Unión Europea

Ciudad de celebración: A Coruña, Galicia, España

Modo de participación: Organizador

Nº de asistentes: 30

Fecha de inicio-fin: 07/09/2007 - 08/09/2007

Duración: 2 días



Evaluación y revisión de proyectos y artículos de I+D+i

1 Funciones desempeñadas: Referee para la revista International Journal of Computer Mathematics

Entidad de realización: Taylor and Francis

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2018 - 2024

2 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Applied Mathematics and Computation

Entidad de realización: Elsevier

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2021 - 2022

3 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Journal of Computational and Applied Mathematics

Entidad de realización: Elsevier

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2015 - 2021

4 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Advances in Mathematical Physics

Entidad de realización: Hindawi

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2020 - 2020

5 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Quantitative Finance and Economics

Entidad de realización: AIMS Press

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2019 - 2019

6 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Applied Mathematical Modelling

Entidad de realización: Elsevier

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2017 - 2017

7 Funciones desempeñadas: Referee para la revista Tribology International

Entidad de realización: Elsevier

Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas

Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE

Fecha de inicio-fin: 2017 - 2017



- 8** **Funciones desempeñadas:** Referee para la revista Journal of Applied Mathematics and Computation
Entidad de realización: Hill Publishing Co
Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas
Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE
Fecha de inicio-fin: 2012 - 2012
- 9** **Funciones desempeñadas:** Referee para la revista Numerical Mathematics: Theory, Methods and Applications
Entidad de realización: Cambridge U. P.
Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas
Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE
Fecha de inicio-fin: 2010 - 2010
- 10** **Funciones desempeñadas:** Referee para la revista International Journal of Non-Linear Mechanics
Entidad de realización: Elsevier
Modalidad de actividad: Revisión de artículos en revistas científicas o tecnológicas
Sistema de acceso: Por designación de quien corresponda sin concurrencia **Ámbito geográfico:** Internacional no UE
Fecha de inicio-fin: 2001 - 2001
- 11** **Funciones desempeñadas:** Evaluador de proyectos de investigación
Entidad de realización: CONYCIT **Tipo de entidad:** Agencia Estatal
Ciudad entidad realización: Chile
Modalidad de actividad: Evaluador de grupos de investigación
Ámbito geográfico: Internacional no UE
- 12** **Funciones desempeñadas:** Evaluador de proyectos de investigación
Entidad de realización: Agencia Nacional de Evaluación y Prospectiva **Tipo de entidad:** Agencia Nacional
Modalidad de actividad: Evaluador de proyectos
Ámbito geográfico: Nacional

Otros méritos

Estancias en centros públicos o privados

- 1** **Entidad de realización:** Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e investigación
Ciudad entidad realización: París, Île de France, Francia
Fecha de inicio-fin: 09/05/2015 - 12/2006 **Duración:** 35 días
Entidad financiadora: Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e investigación
Ciudad entidad financiadora: París, Île de France, Francia
Objetivos de la estancia: Invitado/a



2 **Entidad de realización:** Université de Nice Sophia-Antipolis **Tipo de entidad:** Universidad
Facultad, instituto, centro: Département de Mathématiques
Ciudad entidad realización: Niza, Provence-Alpes-Côte d'Azur, Francia
Fecha de inicio-fin: 05/02/1995 - 18/02/1995 **Duración:** 12 días
Objetivos de la estancia: Invitado/a

3 **Entidad de realización:** Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e Investigación
Facultad, instituto, centro: Institut Aérotechnique de Saint Cyr
Ciudad entidad realización: Saint Cyr l'École, Île de France, Francia
Fecha de inicio-fin: 01/10/1993 - 31/08/1994
Objetivos de la estancia: Contratado/a

4 **Entidad de realización:** Conservatoire National des Arts et Métiers **Tipo de entidad:** Docencia e Investigación
Facultad, instituto, centro: Institut Aérotechnique de Saint Cyr
Ciudad entidad realización: Saint Cyr l'École, Île de France, Francia
Fecha de inicio-fin: 17/04/1990 - 30/09/1993
Objetivos de la estancia: Doctorado/a

Ayudas y becas obtenidas

1 **Nombre de la ayuda:** Beca de formación de personal investigador en el extranjero
Finalidad: Predoctoral
Entidad concesionaria: MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA
Fecha de concesión: 1991 **Duración:** 2 años - 4 meses
Fecha de finalización: 31/12/1993
Entidad de realización: Conservatoire National des Arts et Métiers
Facultad, instituto, centro: Institut Aérotechnique de Saint-Cyr

2 **Nombre de la ayuda:** Beca de formación de personal investigador en España
Finalidad: Predoctoral
Entidad concesionaria: MINISTERIO DE EDUCACION Y CIENCIA
Fecha de concesión: 1990 **Duración:** 1 año - 8 meses
Fecha de finalización: 31/08/1991
Entidad de realización: Universidad Politécnica de Madrid
Facultad, instituto, centro: Escuela Técnica Superior de Ingenieros de Minas

3 **Nombre de la ayuda:** Beca de tercer ciclo
Finalidad: Estudiante de tercer ciclo, colaboración en convenio con empresas
Entidad concesionaria: Departamento de Matemática Aplicada y Métodos Informáticos (UPM) **Tipo de entidad:** Universidad
Fecha de concesión: 01/10/1989
Fecha de finalización: 31/12/1989

4 **Nombre de la ayuda:** Beca de segundo ciclo
Finalidad: Estudiante de segundo ciclo, colaboración en convenio con empresas
Entidad concesionaria: Departamento de Matemática Aplicada y Métodos Informáticos (UPM) **Tipo de entidad:** Universidad



Fecha de concesión: 01/01/1987

Fecha de finalización: 30/09/1989

Sociedades científicas y asociaciones profesionales

1 Nombre de la sociedad: Society for Industrial and Applied Mathematics

Ciudad entidad afiliación: Philadelphia, Estados Unidos de América

Fecha de inicio-fin: 01/01/2007 - 31/12/2018

2 Nombre de la sociedad: Sociedad Española de Matemática Aplicada

Ciudad entidad afiliación: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Nº de socios/as: 500

Fecha de inicio: 01/01/1997

Premios, menciones y distinciones

1 Descripción: Journal of Computational Finance Young Researcher Award at ICCF2019, otorgado a Beatriz Salvador Mancho por un trabajo realizado en colaboración

Entidad concesionaria: Risk.net

Fecha de concesión: 12/07/2019

2 Descripción: Premio ENRESA al mejor Proyecto Fin de Carrera relacionado con el almacenamiento de residuos radiactivos

Entidad concesionaria: Empresa Nacional de Residuos Radiactivos, S.A.

Tipo de entidad: Entidad Empresarial

Ciudad entidad concesionaria: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Fecha de concesión: 1990

3 Descripción: Premio extraordinario de doctorado, 2018/19

Entidad concesionaria: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Reconocimientos ligados: Premio a una tesis doctoral dirigida

4 Descripción: Premio extraordinario de doctorado, 2022/23

Entidad concesionaria: Universidad de La Coruña **Tipo de entidad:** Universidad

Reconocimientos ligados: Premio a una tesis doctoral dirigida

Períodos de actividad investigadora, docente y de transferencia del conocimiento

1 Nombre de la actuación: Sexenio CNEAI

Ámbito geográfico: Nacional

Entidad acreditante: CNEAI

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Ciudad entidad acreditante: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Fecha de obtención: 03/05/2022

Tipo de actividad: Investigación

Calificación Obtenida: Valoración positiva para el tramo solicitado

Año de inicio: 2016

Año de finalización: 2021

Periodo cubierto: 2016, 2017, 2018, 2019, 2020, 2021://:2016, 2017, 2018, 2019, 2020, 2021

**C****V****N**

CURRÍCULUM VÍTAE NORMALIZADO

fe12b850c92924c876dafdc43a401fb1

2 Nombre de la actuación: Quinquenio**Entidad acreditante:** Universidad de La Coruña**Tipo de entidad:** Universidad**Fecha de obtención:** 2022**Tipo de actividad:** Docencia**Calificación Obtenida:** Evaluación favorable**Año de inicio:** 2016**Año de finalización:** 2021**Periodo cubierto:** 2016, 2017, 2018, 2019, 2020, 2021:/::/2016, 2017, 2018, 2019, 2020, 2021**3 Nombre de la actuación:** Quinquenio**Entidad acreditante:** Universidad de La Coruña**Tipo de entidad:** Universidad**Fecha de obtención:** 2017**Tipo de actividad:** Docencia**Calificación Obtenida:** Evaluación favorable**Año de inicio:** 2011**Año de finalización:** 2016**Periodo cubierto:** 2011, 2012, 2013, 2014, 2015, 2016:/::/2011, 2012, 2013, 2014, 2015, 2016**4 Nombre de la actuación:** Sexenio CNEAI**Ámbito geográfico:** Nacional**Entidad acreditante:** CNEAI**Tipo de entidad:** Agencia Estatal**Ciudad entidad acreditante:** Madrid, Comunidad de Madrid, España**Fecha de obtención:** 16/06/2016**Tipo de actividad:** Investigación**Calificación Obtenida:** Valoración positiva para el tramo solicitado**Año de inicio:** 2010**Año de finalización:** 2015**Periodo cubierto:** 2010, 2011, 2012, 2013, 2014, 2015:/::/2010, 2011, 2012, 2013, 2014, 2015**5 Nombre de la actuación:** Quinquenio**Entidad acreditante:** Universidad de La Coruña**Tipo de entidad:** Universidad**Fecha de obtención:** 2012**Tipo de actividad:** Docencia**Calificación Obtenida:** Evaluación favorable**Año de inicio:** 2006**Año de finalización:** 2011**Periodo cubierto:** 2006, 2007, 2008, 2009, 2010, 2011:/::/2006, 2007, 2008, 2009, 2010, 2011**6 Nombre de la actuación:** Sexenio CNEAI**Ámbito geográfico:** Nacional**Entidad acreditante:** CNEAI**Tipo de entidad:** Agencia Estatal**Ciudad entidad acreditante:** Madrid, Comunidad de Madrid, España**Fecha de obtención:** 13/10/2009**Tipo de actividad:** Investigación**Calificación Obtenida:** Valoración positiva para el tramo solicitado**Año de inicio:** 2004**Año de finalización:** 2009**Periodo cubierto:** 2004, 2005, 2006, 2007, 2008, 2009:/::/2004, 2005, 2006, 2007, 2008, 2009



7 Nombre de la actuación: Quinquenio

Entidad acreditante: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Fecha de obtención: 2007

Tipo de actividad: Docencia

Calificación Obtenida: Evaluación favorable

Año de inicio: 2001

Año de finalización: 2006

Periodo cubierto: 2001, 2002, 2003, 2004, 2005, 2006:/::/2001, 2002, 2003, 2004, 2005, 2006

8 Nombre de la actuación: Sexenio CNEAI

Ámbito geográfico: Nacional

Entidad acreditante: CNEAI

Tipo de entidad: Agencia Estatal

Ciudad entidad acreditante: Madrid, Comunidad de Madrid, España

Fecha de obtención: 2003

Tipo de actividad: Investigación

Calificación Obtenida: Valoración positiva para el tramo solicitado

Año de inicio: 1994

Año de finalización: 2002

Periodo cubierto: 1994, 1997, 1999, 2000, 2001, 2002:/::/1994, 1997, 1999, 2000, 2001, 2002

9 Nombre de la actuación: Quinquenio

Entidad acreditante: Universidad de La Coruña

Tipo de entidad: Universidad

Fecha de obtención: 2002

Tipo de actividad: Docencia

Calificación Obtenida: Evaluación favorable

Año de inicio: 1996

Año de finalización: 2001

Periodo cubierto: 1996, 1997, 1998, 1999, 2000, 2001:/::/1996, 1997, 1998, 1999, 2000, 2001