

# MIGUEL ANGEL CABELLO PÉREZ

Doctor en Economía

## RESUMEN

---

Economista con sólidos conocimientos en análisis económico. Especialista en métodos econométricos enfocados en Análisis de series temporales y sus aplicaciones a macroeconomía y finanzas. También en el desarrollo de métodos cuantitativos para análisis micro-económico y estimación de efectos causales.

## EDUCACIÓN

---

**Universidad Carlos III de Madrid**

*Octubre 2018 - Junio 2023*

Doctor en Economía. Mención *Summa Cum Laude*.

Tesis: Ensayos sobre Identificación de modelos VARMA estructurales. (En Inglés)

**Universidad Carlos III de Madrid**

*Setiembre 2016 - Setiembre 2018*

Máster en Análisis Económico.

Tesis: Identificación de modelos SVAR con errores no Gaussianos y restricciones de signo.

**Pontificia Universidad Católica del Perú**

*Marzo 2004 - Diciembre 2009*

Bachiller en Ciencias Sociales, con especialidad en Economía.

Departamento de Ciencias Sociales.

## DOCUMENTOS DE TRABAJO

---

- **Identification and Estimation of Structural VARMA models using generalized pairwise dependence measures.**  
Miguel Angel Cabello.  
(Working Paper)
- **Robust Estimation of the non-Gaussian dimension in structural linear models.**  
Miguel Angel Cabello.  
(Working Paper)
- **Measuring Macroeconomic and Financial Uncertainty in a Small Open Economy.**  
Miguel Angel Cabello y Rafael Nivin.  
(Investigación en curso)
- **Macprudential Policies in Peru: The Effects of Dynamic Provisioning and Conditional Reserve Requirements.** BIS Working Papers Series, No. 675. November, 2017.  
Trabajo conjunto con Joé Lupu y Elías Minaya.

## EXPERIENCIA DE TRABAJO

---

**Banco Central de Reserva del Perú**

*Investigador en Estabilidad Financiera*

Lima, Peru

*Julio 2023-Enero 2024*

- Estimación de Ciclos crediticios.
- Estimación de medidas de incertidumbre macroeconómica y financiera.
- Proyección de Probabilidades de Default agregadas.
- Estimación y proyección de componentes estacionales de pagos diarios con tarjeta.

**Banco Central de Reserva del Perú**

*Analista - Departamento de Programa Monetario*

Lima, Peru

*2013-2016*

- Monitorear indicadores financieros y del mercado de crédito y dinero doméstico e internacional.
- Proyección de la Hoja de Balance del Banco Central.
- Preparar reportes estadísticos sobre el estado de los mercados financieros y de crédito doméstico.
- Preparar reportes y/o estudios de política monetaria e iniciativas macro-prudenciales.

### **Banco Central de Reserva del Perú**

Lima, Peru

*Analista - Departamento de Estadísticas de Balanza de Pagos*

2010-2012

- Manejo y actualización de la base de datos de comercio exterior (importaciones y exportaciones).
- Computo de indicadores de volumen y precios de comercio exterior.
- Preparar reportes estadísticos y económicos sobre el estado de las importaciones y las exportaciones (tradicionales y no tradicionales).
- Mejorar el método de cálculo de los índices de volumen y precios de importaciones y exportaciones.

## **EXPERIENCIA ACADÉMICA**

---

### **Universidad Carlos III de Madrid**

Madrid, España

*Asistente de Cátedra*

2017-2021

- Principios de Economía, Macroeconomía 1, Macroeconomía Dinámica. (Estudios de Pregrado)
- Econometría 1, Técnicas Econométricas. (Estudios de Pregrado)
- Microeconomía 1, Teoría de Juegos, Microeconometría. (Estudios de Posgrado - Maestría)
- Econometría 1, Economía Aplicada. (Estudios de Posgrado - Maestría en Investigación)

### **Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas**

Lima, Peru

*Asistente de Cátedra - Estudios de Pregrado*

2015-2016

- Macroeconomía Aplicada, Macroeconomía Avanzada.
- Macroeconometría.

### **Universidad de Piura**

Lima, Peru

*Asistente de Cátedra - Estudios de Pregrado*

2014-2016

- Econometría de Series Temporales.

### **Pontificia Universidad Católica del Perú**

Lima, Peru

*Asistente de Cátedra*

2011-2015

- Econometría 1 y 2. (Estudio de Pregrado)
- Econometría Avanzada. (Estudios de Posgrado - Maestría)

## **HONORES Y LOGROS**

---

1. Competencia "Econometrics Game", 2018. Equipo UC3M. **1er Lugar.**
2. Competencia "Econometrics Game", 2019. Equipo UC3M. **Finalistas**
3. Beca Fundación BBVA para estudios de pregrado (2006-2009).

## **HABILIDADES**

---

### **Programación:**

Matlab, Stata, E-Views, MS-Office, Julia, R, LaTeX, Python, SQL, y Fox-Pro.

### **Idiomas:**

Español (nativo), Inglés (fluido - B2).

## INTERESES DE INVESTIGACIÓN

---

Estoy interesado en el desarrollo de métodos en Econometría de Series Temporales, tanto de modelos lineales como no lineales. Asimismo, la aplicación de estos métodos para la predicción y now-casting, econometría financiera y datos de panel largos.