







ANDRÉS RICARDO SOSA **RODRÍGUEZ**

Dr.

andres.sosa@fcea.edu.uy Av. Gonzalo Ramírez 1926 2411 8839

SNI

Ciencias Naturales y Exacta s / Matemáticas Categorización actual: Nivel I (Activo)

Fecha de publicación: 16/12/2023 Última actualización: 16/12/2023

Datos Generales

INSTITUCIÓN PRINCIPAL

Universidad de la República/ Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Departamento de Métodos Cuantitativos / Uruguay

DIRECCIÓN INSTITUCIONAL

Institución: Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración /

Sector Educación Superior/Público

/ Departamento de Métodos Cuantitativos

Dirección: Gonzalo Ramírez 1926 / 11200

País: Uruguay / Montevideo / Montevideo

Teléfono: (+598) 24118839

Correo electrónico/Sitio Web:andres.sosa@fcea.edu.uy http://www.iesta.edu.uy

Formación

Formación académica

CONCLUIDA

DOCTORADO

Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA) (2013 - 2018)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias, Centro de Matemática, Uruguay

Título de la disertación/tesis/defensa: Modelos estocásticos en tasas de interés y aplicaciones en la deuda soberana en Uruguay

Tutor/es: Ernesto Mordecki Obtención del título: 2018

Sitio web de la disertación/tesis/defensa:

http://www.cmat.edu.uy/cmat/biblioteca/documentos/tesis/tesis-de-doctorado

Financiación:

Universidad de la República / Comisión Académica de Posgrado, Uruguay

Palabras Clave: Interest Rate Model Term Structure Kalman Filter Default Risk Country Risk Index Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Riesgo de Mercado

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Modelos Paramétricos

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

MAESTRÍA

Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática) (2009 - 2011)

Universidad de la República - Facultad de Ingeniería, Uruguay

Título de la disertación/tesis/defensa: Valuación de opciones en mercados de Lévy con Enfoque en

Riesgo Cambiario Crediticio en el Uruguay

Tutor/es: Ernesto Mordecki Pupko

Obtención del título: 2011

Sitio web de la disertación/tesis/defensa: http://premat.fing.edu.uy/IngenieriaMatematica/

Financiación:

Agencia Nacional de Investigación e Innovación / Agencia Nacional de Investigación e Innovación,

Uruguay

Palabras Clave: Riesgo Cambiario Crediticio

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Riesgo

ESPECIALIZACIÓN/PERFECCIONAMIENTO

Certificado en Econometría (2014 - 2015)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Sociales, Departamento de Economía, Uruguay Título de la disertación/tesis/defensa: -

Obtención del título: 2015 Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometria Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempos

Diploma en Economía y Gestión Bancaria (2010 - 2010)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Sociales, Departamento de Economía, Uruguay Título de la disertación/tesis/defensa: --

Obtención del título: 2010

Palabras Clave: Sistema Bancario Riesgo Macroeconomía Microeconomía

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Gestión Bancaria Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Negocios y Administración / Análisis de Riesgos

GRADO

Licenciatura en Matemática (2004 - 2008)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias , Uruguay Título de la disertación/tesis/defensa: Modelo de Black-Scholes

Tutor/es: Ernesto Mordecki Obtención del título: 2009 Palabras Clave: Black-Scholes Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelos matemáticos en

-inanzas

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Idiomas

Inglés

Entiende regular / Habla bien / Lee muy bien / Escribe bien

Areas de actuación

CIENCIAS NATURALES Y EXACTAS

Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelos matemáticos en Finanzas

CIENCIAS NATURALES Y EXACTAS

Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

CIENCIAS SOCIALES

Economía y Negocios /Economía, Econometría /Estudio de series de tiempo

CIENCIAS SOCIALES

Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía Bancaria

Actuación profesional

SECTOR EDUCACIÓN SUPERIOR/PÚBLICO - UNIVERSIDAD DE LA REPÚBLICA - URUGUAY

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Departamento de Métodos Cuantitativos

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (05/2019 - a la fecha) Trabajo relevante

Profesor Adjunto 30 horas semanales / Dedicación total Escalafón: Docente Grado: Grado 3 Cargo: Efectivo

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Grupo de Investigación en Dinámica Económica (05/2019 - a la fecha)

El Grupo de Investigación en Dinámica Económica está formado por investigadores de distintas áreas, incluyendo Economía, Matemática, Estadística, Informática, Física y Sociología. Este grupo interdisciplinario tiene como línea de investigación general, el estudio de fenómenos dinámicos en Economía y Ciencias Sociales, sea desde una perspectiva teórica, aplicada o empírica.

Aplicada

5 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Integrante del equipo

Equipo: SOSA ANDRES, BRIDA, J.G., CAYSSIALS, G., Alvarez E.

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Finanzas Cuantitativas (05/2019 - a la fecha)

De manera general, es posible establecer que las Finanzas Cuantitativas se basan en disciplinas como la teoría de la probabilidad, estadística, programación y ecuaciones diferenciales en derivadas parciales. Uno de sus objetivos principales es proporcionar modelos con el fin de obtener relaciones entre sus variables fundamentales. Los análisis en este campo de investigación permiten obtener conclusiones que de otra manera serían difíciles de encontrar, en especial al utilizar nuevas técnicas de almacenamiento de datos y al modelar diversas variables en forma simultánea, brindando la resolución de sistemas complejos. Los proyectos que ser proponen investigar presentan distintas temáticas. Entre ellos se destacan el análisis de la estructura de datos financieros en Uruguay, la aplicación de modelos de volatilidad en la evolución temporal de los activos financieros y la valuación de derivados financieros en renta fija (modelación de tasas de interés) y en renta variable (opciones sobre índices bursátiles).

Aplicada

 $10\,\mathrm{horas}$ semanales , Coordinador o Responsable

Equipo: SOSA ANDRES Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Grupo de Investigación Modelización Estadística para Análisis de Datos (MESTAD) (02/2020 - a la fecha)

Este grupo de investigación fue creado junto a los investigadores del Instituto de Estadística Dr. Ignacio Álvarez, Dra. Natalia da Silva y Dr. Leonardo Moreno en el año 2019. El objetivo de este grupo es consolidar los trabajos independientes de cada uno de los participantes en temas afines de interés académico. En la actualidad comenzamos a investigar los métodos de aprendizaje estadístico interpretables poniendo el foco en métodos supervisados con aplicaciones a problemas económicos. De manera general, es posible establecer que en el grupo nos proponemos trabajar en tres grandes pilares donde algunos de los aspectos de interpretabilidad de los métodos es relevante. Modelos predictivos para el precio de los inmuebles en Montevideo, modelos predictivos para valuar los bosques a nivel mundial y modelos de predicción de rendimientos de distintos portafolios de inversión a nivel regional usando la base de datos Bloomberg serán los objetivos a mediano plazo.

Mixta

10 horas semanales, Integrante del equipo

Equipo: SOSA ANDRES, Alvarez-Castro, I, da Silva N, Leonardo MOREIRA CABRERA

Palabras clave: Aprendizaje automático;

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Junto a Dr. Ignacio Álvarez, como una rama del Grupo MESTAD, estamos desarrollando un grupo de estudio en el área denominada Sport Analytics. Esta área se refiere al uso de datos y estadísticas avanzadas para medir el rendimiento en actividades de competencia deportiva. Entre los primeros resultados se encontraron el análisis de los tiros que se ejecutan en la Liga Uruguaya de Basketball 2019-2020. Posteriormente, continuamos con la investigación en esta linea de trabajo aportando la información de las estadísticas avanzadas por jugador en la Liga Uruguaya de Basketball 2020-2021. El rumbo de trabajo indica continuar generando conocimiento sobre la amplia literatura científica que existe en la temática y obtener resultados parciales en algunos deportes donde sea posible la obtención de datos.

Aplicada

4 horas semanales, Integrante del equipo

Equipo: SOSA ANDRES, Alvarez-Castro, I

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN Y DESARROLLO

Manuales Didáctico Cálculo 1A (10/2020 - a la fecha)

La edición del material surge principalmente por dos motivos. El primero es el cambio de algunos contenidos en el curso durante 2018 y 2019, que llevaron a contar en el primer semestre de 2020 con una nueva edición de las notas, que se utilizó en el primer y segundo semestre de 2020. Con un año de experiencia se encuentran sugerencias de modificaciones, en particular en la parte de ejercicios, para tener distintos niveles de dificultad y ampliar la selección actual. Como segundo motivo, debido a la virtualidad en el dictado del curso en ambos semestres de 2020, se generó mucho material en formato audiovisual (exposiciones sobre diferentes temas, ejercicios resueltos), y es de interés del equipo docente hacer una revisión de estos materiales e incorporarlos como referencia. Sin lugar a dudas, esto generaría una guía para el uso del material por parte del estudiante con el fin de intentar atender las diferentes manera de aprendizaje de los estudiantes. 10 horas semanales

Comisión Sectorial de Enseñanza , Departamento de Métodos Cuantitativos - FCEA - UdelaR Otra

Coordinador o Responsable

En Marcha

Financiación:

Comisión Sectorial de Enseñanza, Uruguay, Apoyo financiero

Equipo: SOSA ANDRES, Laura Aspirot, Fernando Pelaez, Pedro Sakorko

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Didáctica

DOCENCIA

Licenciatura en Estadística (08/2022 - 12/2022)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Estadística en el Deporte, 48 horas, Teórico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

$Contador\ P\'ublico\ -\ Licenciatura\ en\ Administraci\'on\ -\ Licenciatura\ en\ Econom\'ia\ (08/2022\ -\ 12/2022\)$

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo I, 54 horas, Teórico-Práctico

Contador Público - Licenciatura en Administración - Licenciatura en Economía (03/2022 - 08/2022)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo I, 54 horas, Teórico-Práctico

Contador Público - Licenciado en Administración (02/2021 - 08/2021)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo 1A, 56 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Maestría en Finanzas (05/2021 - 05/2021)

Maestría

Invitado

Asignaturas:

Metodologías de la Investigación, 10 horas, Teórico

Licenciatura en Estadística (08/2020 - 12/2020)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Estadística en el Deporte, 28 horas, Teórico-Práctico

Contador Público - Licenciado en Administración (02/2020 - 12/2020)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo 1A, 56 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Maestría en Finanzas (05/2020 - 05/2020)

Maestría

Invitado

Asignaturas:

Metodologías de la Investigación, 4 horas, Teórico

Contador Público - Economista (05/2019 - 12/2019)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo 1, 56 horas, Teórico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Licenciatura en Estadística (08/2019 - 12/2019)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Grupo de Estudio en Estadística en el Deporte, 2 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

PASANTÍAS

Centro de Investigación y Modelamiento de Fenómenos Aleatorios (07/2019 - 08/2019)

Universidad de Valparaíso, Facultad de Ingeniería

40 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

GESTIÓN ACADÉMICA

Comisión Asesora Llamado Profesor Adjunto Grado 3 de la Unidad Académica Matemática del Departamento de Métodos Cuantitativos / Participación en consejos y comisiones (08/2021 - 12/2022

Participación en consejos y comisiones 3 horas semanales

Organización de las Jornadas Académicas de Facultad de Ciencias Económicas y de Administración 2022 (02/2022 - 10/2022)

Gestión de la Investigación 2 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Iniciación a la Investigación del Instituto de Estad?itica del Departamento de Métodos Cuantitativos / Participación en consejos y comisiones (04/2022 - 06/2022)

Participación en consejos y comisiones 5 horas semanales

Delegado Comisión Dedicación Total (11/2019 - 02/2022)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Ayudante Grado 2 de la Unidad Académica Matemática del Departamento de Métodos Cuantitativos (08/2020 - 03/2021)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Departamento de Métodos Cuantitativos Participación en consejos y comisiones 4 horas semanales

Organización del Seminario del Instituto de Estadística SIESTA (01/2020 - 02/2021)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Instituto de Estadística Gestión de la Investigación 5 horas semanales

Comisión asesora del Departamento de Métodos Cuantitativos de relección de un cargo Gr 2 Efectivo (11/2020 - 12/2020)

Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

Comisión asesora del Departamento de Métodos Cuantitativos de relección de un cargo Gr 2 Efectivo (11/2020 - 12/2020)

Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Ayudante Grado 1 de la Unidad Académica Especialización en Estadística del Departamento de Métodos Cuantitativos (08/2020 - 10/2020)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Departamento de Métodos Cuantitativos Participación en consejos y comisiones 4 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Ayudante Grado 1 de la Unidad Académica Matemática del Departamento de Métodos Cuantitativos (09/2019 - 12/2019)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Departamento de Métodos Cuantitativos Participación en consejos y comisiones 4 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Ayudante Grado 1 de la Unidad Académica Especialización en Estadística del Departamento de Métodos Cuantitativos (09/2019 - 12/2019)

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Departamento de Métodos Cuantitativos Participación en consejos y comisiones 4 horas semanales

SECTOR EDUCACIÓN SUPERIOR/PÚBLICO - UNIVERSIDAD DE LA REPÚBLICA - URUGUAY

Facultad de Ciencias / Centro de Matemática

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (04/2017 - 05/2019) Trabajo relevante

Asistente Grado 2 - Centro de Matemática 30 horas semanales / Dedicación total Escalafón: Docente Grado: Grado 2 Cargo: Efectivo

Asistente Grado 2 Centro de Matemática 30 horas semanales

Escalafón: Docente Grado: Grado 2 Cargo: Interino

Funcionario/Empleado (05/2009 - 07/2012)

Ayudante Grado 1 Centro de Matemática 20 horas semanales

Escalafón: Docente Grado: Grado 1 Cargo: Interino

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Métodos Estocásticos en Finanzas (04/2017 - 05/2019)

Formo parte de un grupo de estudio en aplicación de procesos estocásticos en finanzas.

Mixta

2 horas semanales

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática, Integrante del equipo Equipo: SOSA ANDRES, MORDECKI, E., F. De Olivera, MAGNOU, G.

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Mellizos y Gemelos en el Uruguay (04/2017 - 05/2019)

Colaboro en la confección estadística de los modelos a utilizar y en la manipulación de datos. Fui contactado por la estudiante de la Licenciatura Noelia Gómez, con el fin de participar en el proyecto. Los resultados obtenidos fueron expuestos en el II Encontro de Gemeos na USP, en San Pablo - Brasil.

Aplicada

2 horas semanales

Facultad de Ciencias, Integrante del equipo

Equipo: NOELIA GOMEZ , SILVIA CORTE , MONICA SANS

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Biología Reproductiva /

$Model: Zero\,Black\,Derman\,Toy\,(12/2016-05/2019\,)$

Generación de modelo de tasas de interés

Aplicada

5 horas semanales

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática, Integrante del equipo Equipo: MORDECKI, ERNESTO, KRZY?ANOWSKI, GRZEGORZ

Palabras clave: Modelación de Tasa de Interés

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

DOCENCIA

Licenciatura Bioqímica/Ciencias Biológicas (08/2017 - 12/2017)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Bioestadística, 94 horas, Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Licenciatura en Recursos Naturales (08/2017 - 12/2017)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática 1, 94 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Licenciada en Ciencias Biológicas (08/2016 - 12/2016)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y Estadística, 6 horas, Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2016 - 08/2016)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Bioestadística, 6 horas, Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2016 - 08/2016)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I, 6 horas, Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura /

(11/2015 - 11/2015)

Grado

Invitado

Asignaturas:

Cadena de Markov, 4 horas, Teórico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2015 - 08/2015)

Grado

Organizador/Coordinador

Asignaturas:

Matemática I, 10 horas, Teórico-Práctico

(08/2014 - 12/2014)

Grado

Organizador/Coordinador

Asignaturas:

Bioestadística / Tratamiento de Datos y Diseño, 6 horas, Práctico

(03/2014 - 08/2014)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y estadística, 6 horas, Práctico

(08/2013 - 12/2013)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Bioestadística / Tratamiento de Datos y Diseño, 6 horas, Práctico

(08/2013 - 12/2013)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción al cálculo diferencial e integral, 8 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

(03/2013 - 07/2013)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y estadística, 6 horas, Práctico

(08/2012 - 12/2012)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Bioestadística / Tratamiento de Datos y Diseño, 6 horas, Práctico

(08/2011 - 12/2011)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I Segundo Semestre, 8 horas, Práctico

(03/2011 - 07/2011)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I, 6 horas, Práctico

(08/2010 - 12/2010)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática II, 6 horas, Práctico

EXTENSIÓN

Proyecto Imaginary (01/2015 - 05/2019)

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

2 horas

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Divulgación Matemática

Semana de la Ciencia y la Tecnología (05/2016 - 06/2016)

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

2 horas

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Divulgación

Latitud Ciencias (03/2013 - 07/2013)

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

3 horas

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Difusión

PASANTÍAS

Pasantía: Fundación Getulio Vargas (03/2017 - 05/2017)

Fundación Getulio Vargas, The Brazilian School of Public and Business Administration 40 horas semanales

Pasantía: Quantitative Risk Research (10/2011 - 11/2011)

Universidad Autónoma de Madrid, Quantitative Risk Research

40 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

GESTIÓN ACADÉMICA

Delegado por el Centro de Matemática en la Comisión: Evaluación Docente en la Función de Enseñanza (01/2017 - 05/2019)

Facultad de Ciencias Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

Delegado docente en la Directiva del Centro de Matemática (08/2015 - 07/2017)

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática Participación en consejos y comisiones

SECTOR EMPRESAS/PRIVADO - EMPRESA PRIVADA - URUGUAY

Banco Itaú

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (12/2011 - 09/2012) Trabajo relevante

Analista de Crédito Wholesale 40 horas semanales

CARGA HORARIA

Carga horaria de docencia: 10 horas Carga horaria de investigación: 20 horas Carga horaria de formación RRHH: 2 horas Carga horaria de extensión: 2 horas Carga horaria de gestión: 6 horas

Producción científica/tecnológica

Mi tema de investigación se centra en el estudio de las finanzas cuantitativas.

Es la principal área de investigación en la cual participo. Desde la Licenciatura en Matemática estudio temas vinculados a las Finanzas Cuantitativas. Es posible definirla como el área de matemática aplicada relacionada al análisis de los mercados financieros.

De manera general, es posible establecer que las finanzas cuantitativas es el área de matemática aplicada relacionada al análisis de los mercados financieros. Esta área se basa en disciplinas como la teoría de la probabilidad, estadística, programación y ecuaciones diferenciales en derivadas parciales. Uno de sus objetivos principales es proporcionar modelos con el fin de obtener relaciones entre sus variables fundamentales. Los análisis en este campo de investigación permiten obtener conclusiones que de otra manera serían difíciles de encontrar, en especial al utilizar nuevas técnicas de almacenamiento de datos y al modelar diversas variables en forma simultánea, brindando la resolución de sistemas complejos.

Los bancos comerciales, los fondos de inversión, las compañías de seguros y las agencias reguladoras aplican sus conocimientos en la valuación de activos y derivados financieros, la estructura de portafolio, la gestión de riesgos y la simulación de posibles escenarios . En la actualidad , los proyectos que estoy vinculado presentan distintas temáticas. Entre ellos se destacan el análisis de la estructura de datos financieros en Uruguay, la aplicación de modelos de volatilidad en la evolución temporal de los activos financieros y la valuación de derivados financieros en renta fija (modelación de tasas de interés) y en renta variable (opciones sobre índices bursátiles).

Mis principales contribuciones las realicé en el área de valuación de derivados financieros (sobre renta fija y renta variable), más precisamente, en el área de la valuación del derivado financiero denominado opciones. Esta fijación de precios la realizamos mediante ciertos métodos que dependen de los datos disponibles en el mercado. Este desarrollo permite calcular precios de opciones teóricos en países, como Uruguay, que no tiene un mercado muy desarrollado. La motivación que encuentro para investigar en estos temas de matemática y finanzas es encontrar acercamiento entre la investigación y las prácticas habituales de los agentes participantes del mercado, al reducir la distancia entre los dos ámbitos en Uruguay.

Producción bibliográfica

ARTÍCULOS PUBLICADOS

ARBITRADOS

The Dynamical Relation Between Price Changes and Trading Volume (Completo, 2023)

SOSA ANDRES, Alvarez E., BRIDA, J.G., L. MORENO

Quality & Quantity, v.: 57 p.:5355 - 5379, 2023

Medio de divulgación: Internet Lugar de publicación: Springer

E-ISSN: 15737845

DOI: https://doi.org/10.1007/s11135-022-01605-4

Scopus'

Zero Black-Derman-Toy Model in Catastrophic Events: COVID-19 Performance Analysis (Completo,

2022) Trabajo relevante

SOSA ANDRES, KRZYZANOWSKI, G.

The Journal of Derivatives, v.: 30 1, p.: 103 - 118, 2022

Palabras clave: Zero Interest Rate Policy Black Derman Toy Model COVID-19

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Finanzas Cuantitativas

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 10741240 E-ISSN: 21688524

DOI: https://doi.org/10.3905/jod.2022.1.164

https://jod.pm-research.com/

Scopus'

On the impact of the Covid-19 health crisis on GDP forecasting: An empirical approach (Completo, 2022)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E., ILLANES, G.

Journal of Dynamics & Games, 2022

Palabras clave: Covid-19 pandemic public health epidemiology GDP forecasting Correlation

analysis linear models

Medio de divulgación: Internet

ISSN: 21646074

DOI: 10.3934/jdg.2022008

Scopus

Zero Black-Derman-Toy Interest Rate Model (Completo, 2021) Trabajo relevante

SOSA ANDRES. MORDECKI. E. . KRZRYZANOWSKI. G.

The Journal of Fixed Income, v.: 314, 2021

Palabras clave: Zero Interest Rate Policy Option Price Black Derman Toy Model 2007:2008 crisis

in the United States Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas Cuantitativas

Medio de divulgación: Internet

Lugar de publicación: Institutional Investor Journals Umbrella

ISSN: 10598596 E-ISSN: 21688648

DOI: https://doi.org/10.3905/jfi.2021.1.123

https://jfi.pm-research.com/

Scopus*

Country risk index for emerging economies: a dynamical proposal with a case study (Completo, 2020)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E.

Brazilian Review of Econometrics, p.:285 - 302, 2020

Palabras clave: country risk index emerging markets sovereign debt Kalman filter

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Internet

Lugar de publicación: Brasil

ISSN: 25263722 E-ISSN: 1980-2447

DOI: https://doi.org/10.12660/bre.v40n22020.80944 http://bibliotecadigital.fgv.br/ojs/index.php/bre

Country risk index; Emerging markets; Sovereign debt; Kalman filter

Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. (Completo, 2020)

SOSA ANDRES

Cuadernos del CIMBAGE, 2020

Palabras clave: Curvas de rendimiento Modelos de tasas de interés Bonos soberanos

Medio de divulgación: Internet

ISSN: 16665112 E-ISSN: 1666-5112

latindex

Long-range dependence in the volatility of returns in Uruguayan Sovereign debt indices (Completo, 2020)

SOSA ANDRES, KALEMKERIAN, J.

Journal of Dynamics & Games, v.: 73, p.:225 - 237, 2020

Palabras clave: Interest rate Index Fractional Brownian Motion Uruguayan sovereign debt

Medio de divulgación: Internet

ISSN: 21646074

DOI: http://dx.doi.org/10.3934/jdg.2020016

Scopus'

Twinning Rates in Uruguay Between 1999 and 2015: Association with Socioeconomic and Demographic Factors (Completo, 2019) Trabajo relevante

SOSA ANDRES, GÓMEZ, N., CORTE, S., OTTA, E.

Twin Research and Human Genetics, v.: 22 1, p.:56 - 61, 2019

Palabras clave: twinning rates socioeconomic variables demographic factors assisted reproduction techniques

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Geografía Económica y Social / Geografía Económica y Social /

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Cambridge University Press

ISSN: 18324274

DOI: https://doi.org/10.1017/thg.2018.70

https://www.cambridge.org/core/journals/twin-research-and-human-genetics

Scopus'

Pricing Bond Options in Emerging Markets: a case study (Completo, 2018) Trabajo relevante

SOSA ANDRES. MORDECKI, E., MAGNOU, G.

Journal of Dynamics & Games, v.: 51, p.:21 - 30, 2018

Palabras clave: Price Sovereign Bond Options Black Derman Toy Model Vasicek Model Emerging

Markets

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: American Institute of Mathematical Sciences

ISSN: 21646074

DOI: http://dx.doi.org/10.3934/jdg.2018003

Scopus[®] WEB OF SCIENCE™

Modelación del Mercado de Bonos Soberanos en Moneda Nacional en Uruguay (Completo, 2018)

SOSA ANDRES

Perspectivas, v.: 12 1, p.:31 - 46, 2018

Palabras clave: Bonos soberanos valuación de activos de renta fijacurvas de rendimiento en

Uruguay

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 20072104

http://publicaciones.eco.uaslp.mx/Pagina1.htm

latindex

A Macroeconmics Model Of Credit Risk In Uruguay (Completo, 2016) Trabajo relevante

SOSA ANDRES, ILLANES, G., PENA, A.

Revista Brasileira de Economia, v.: 704, p.:441 - 455, 2016

Palabras clave: Macroeconomics Credit Risk

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelación de Riesgo

Medio de divulgación: Papel Lugar de publicación: Rio de Janeiro

E-ISSN: 00347140

http://bibliotecadigital.fgv.br/ojs/index.php/rbe

Scopus latindex

Estudio Espectral del Mercado Laboral en Uruguay (Completo, 2015)

SOSA ANDRES

Compendium Cuadernos de Economía y Administración, v.: 24, p.:47 - 68, 2015

Palabras clave: Series Temporales Análisis Espectral Mercado Laboral

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis Espectral

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Guayaquil, Ecuador

Escrito por invitación ISSN: 13908391 E-ISSN: 13909894

http://www.revistas.espol.edu.ec/index.php/compendium/index

Caracterización y Estimación del riesgo cambiario crediticio en economías parcialmente dolarizadas (Completo, 2013)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E., PENA, A.

Revista de Economía, v.: XX 2, p.:61 - 91, 2013

Palabras clave: Riesgo Cambiario Crediticio economías parcialmente dolarizadas

Areas de conocimiento:

 $Ciencias \, Sociales \, / \, Economía \, y \, Negocios \, / \, Economía, \, Econometría \, / \, Economías \, altamente$

dolarizadas

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 07975546 E-ISSN: 16880668 http://www.bcu.gub.uy

latindex

Exchange Credit Risk, Measurement and Implications on the stability of partially dollarized financial system (Completo, 2013)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E., PENA, A.

Risk Governance and Control Financial Markets & Institutions, v.: 3 2 2013, p.:58 - 73, 2013 Palabras clave: Risk Management Exchange Credit Risk partially dollarized financial system Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Papel

E-ISSN: 20774303

http://www.virtusinterpress.org/IMG/pdf/RGC_Volume_3_Issue_2_2013_contents.pdf

LIBROS

Trends in Mathematical Economics (Participación, 2016)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E.

Publicado

Editorial: Springer International Publishing Switzerland, Estados Unidos

Tipo de puplicación: Investigación DOI: 10.1007/978-3-319-32543-9_17

Referado

Escrito por invitación

Palabras clave: Gaussians Models

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelación en Tasas de

Interés

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Medio de divulgación: Papel ISSN/ISBN: 9783319325439

http://www.springer.com/gp/book/9783319325415

Capítulos:

Modeling the uruguayan debt through gaaussians Models

Organizadores: Alberto A. Pinto, Elvio Accinelli Gamba, Athanasios N. Yannacopoulos, Carlos

Hervés-Beloso

Página inicial 331, Página final 346

Enseñar Investigando (Participación, 2015)

SOSA ANDRES, BERGÓS, HUGO COITIÑO, CECILIA SILVARREY

Publicado

Editorial: DIRAC, Montevideo Tipo de puplicación: Investigación

Escrito por invitación Areas de conocimiento:

Humanidades / Otras Humanidades / Otras Humanidades / Metodología de enseñanza en relación

a la investigación

Medio de divulgación: Papel ISSN/ISBN: 9789974012738

Capítulos:

ConCiencias en Malvín Norte: el barrio visto desde las ciencias Organizadores: Carolina Cabrera; Marcela Ferreño; Amílcar Davyt

Página inicial 51, Página final 59

DOCUMENTOS DE TRABAJO

Análisis de los tiros ejecutados en la LUB 19-20 (2021)

Completo

 ${\sf SOSA\,ANDRES\,,\,Alvarez\text{-}Castro,\,I\,,\,BARREIRO,\,L.\,,\,GRAU,\,M.\,,\,BATISTA,\,M.}$

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Sport Analytics

Medio de divulgación: Internet

https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/publicaciones/documentos-de-trabajo/

Reporte sobre los mercados financieros en el actual contexto de la pandemia derivada de la enfermedad por COVID-19 (2020)

Completo

SOSA ANDRES

https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/publicaciones/notas-de-reflexion-aportes-sobre-covid-19/

Medio de divulgación: Internet http://www.iesta.edu.uy/

Análisis de los métodos de estimación de curvas de rendimiento en deuda soberana aplicados en Uruguay (2019)

Completo

SOSA ANDRES

Montevideo

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Internet http://www.iesta.edu.uy/

Las probabilidades de clasificación de Uruguay al mundial de fútbol Rusia 2018 (2016)

Completo

SOSA ANDRES, MORDECKI, E.

Serie: 1,

Palabras clave: Simulación Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Medio de divulgación: Internet

http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/probabilidad-eliminatorias.pdf

Un Modelo Macroeconómico del Riesgo de Crédito en Uruguay (2014)

Completo

SOSA ANDRES, ILLANES, G., PENA, A.

Serie: -,

http://www.bcu.gub.uy

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelos De Riesgo de

Crédito

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Macroeconomía

Medio de divulgación: Internet

http://www.bcu.gub.uy

PUBLICACIÓN DE TRABAJOS PRESENTADOS EN EVENTOS

Disaster Risk Reduction (2017)

 ${\sf SOSA\,ANDRES\,, Santos\,Leonardo\,, Londe\,Luciana\,, Aguilar\,Viviana\,, Obreg\'on\,Guillermo}$

Publicado Completo

Evento: Internacional

Descripción: International Workshop on Mathematics of. Climate Change and Natural Disasters

Ciudad: São José dos Campos

Año del evento: 2017

Anales/Proceedings: Final Report: Mathematics Threat Hazard

Pagina inicial: 35 Pagina final: 45

Medio de divulgación: Internet Financiación/Cooperación:

Agencia Nacional de Investigación e Innovación / Apoyo financiero, Uruguay

http://www.lac.inpe.br/cciarm/

TEXTOS EN PERIÓDICOS O REVISTAS

¿Cuánto dura la ola celeste? (2016)

Lento v: 45, 17, 21

Revista

SOSA ANDRES, MORDECKI, ERNESTO

Palabras clave: Difusión Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Medio de divulgación: Papel Fecha de publicación: 01/12/2016 Lugar de publicación: Montevideo

La desocupación es la variable macroeconómica que más incide en el nivel de morosidad bancaria (2014)

Búsqueda

Revista SOSA ANDRES

Palabras clave: Desocupación. Morosidad.

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Negocios y Administración / Gestión de la tasa de

morosidad

Medio de divulgación: Papel Fecha de publicación: 12/06/2014 Lugar de publicación: Montevideo http://www.busqueda.com.uy/

El artículo no es escrito por ningún integrante de nuestro grupo de investigación. El artículo publicado se generó mediante una reunión con los periodistas y el documento de trabajo publicado en la página del Banco Central del Uruguay. En el artículo se hace plena referencia hacia el equipo de investigación. No logré quitarme como autor.

Evaluaciones

EVALUACIÓN DE PUBLICACIONES

REVISIONES

Revista de Análisis de Economía, Comercio y Negocios Internacionales (2019 / 2019)

Tipo de publicación: Revista Cantidad: Menos de 5

Revista Sociedad y Economía (2018 / 2018)

Tipo de publicación: Revista Cantidad: Menos de 5

Brazilian Journal of Probability and Statistics (2015 / 2016)

Tipo de publicación: Revista Cantidad: Menos de 5

JURADO DE TESIS

Maestría en Finanzas (2022)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay Nivel de formación: Maestría

Maestría en Matemática (2020)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias , Uruguay Nivel de formación: Maestría

Licenciatura en Matemática (2017)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias , Uruguay Nivel de formación: Grado

Maestría en Ingeniería Matemática (2015)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería , Uruguay Nivel de formación: Maestría

Formación de RRHH

TUTORÍAS CONCLUIDAS

POSGRADO

Fondos de Ahorro Previsional en Uruguay: eficiencia y regulación (2020 - 2022)

Tesis de maestria

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas

y de Administración , Uruguay Programa: Maestría en Finanzas

Tipo de orientación: Tutor único o principal Nombre del orientado: Alejandro Crossa

País: Uruguay

Palabras Clave: Modelos de Optimización de Portafolios

Otros datos relevantes

PREMIOS, HONORES Y TÍTULOS

Premio Jorge Blanco (2021)

(Internacional)

Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística

El objetivo fue presentar trabajos inéditos sobre cualquier tema del área de estadística realizado por "Jóvenes Investigadores". Obtuve el primer premio con el trabajo A Dynamic Approach for Pricing Options on Interest Rate in Uruguay

PRESENTACIONES EN EVENTOS

Seminario del Instituto de Estadística (2022)

Seminario

Aplicaciones del modelo Gaussian Affine Term Structure Multidimensional en la deuda soberana uruguaya

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Instituto de Estadística

Congreso Interdisciplinario COVID 19, pandemia y pospandemia (2022)

Congreso

El Impacto de la Crisis Sanitaria del COVID-19 en las Proyecciones de Crecimiento Económico Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Espacio Interdisciplinario de la Universidad de la República

XXII Jornadas Latinoamericanas de Teoría Económica (2022)

Encuentro

Modelo Zero Black Derman Toy

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Asociación Latinoamericana de Teoría Económica

Seminario de Probabilidad y Estadística (2021)

Seminario

Análisis estadístico de los Tiros Ejecutados en la Liga Uruguaya de Basketball 2019-2020

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 2

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística (2021)

Congreso

Una Propuesta Dinámica del Índice Riesgo País en Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Sociedad Uruguaya de Estadística

VI Jornadas de Estadística Aplicada (2021)

Encuentro

Dos Proyectos de Análisis Estadístico en la Liga Uruguaya de Basaketball

Uruguav

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Centro Universitario Regional del Este

Seminario de Probabilidad y Estadística (2020)

Seminario

Una mirada sobre los mercados financieros en el contexto de la pandemia derivada por COVID-19. Momentos de gran volatilidad, datos actuales y proyecciones.

Uruguav

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Seminario del Instituto de Estadística (2020)

Seminario

Reporte sobre los mercados financieros en el actual contexto de pandemia derivada de la enfermedad por COVID-19

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario de Investigación Económica (2020)

Seminario

Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. Caso de estudio: Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay

Grupo de Estudio Estadística en el Deporte (2020)

Seminario

Análisis de tres artículos científicos en el área Sport Analytics

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario Grupo de Investigación en Dinámica Económica (2020)

Seminario

El multiplicador de los ingresos de los sectores institucionales y la incidencia de sus relaciones: Una metodología macroeconómica de entrada-salida y un ejercicio para la economía mexicana Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario del Instituto de Estadística (2020)

Seminario

Análisis estadístico de los Tiros Ejecutados en la Liga Uruguaya de Basketball 2019-2020 Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Jornadas Académicas de Facultad de Ciencias y Administración (2019)

Seminario

Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. Caso de estudio: Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

V Jornadas de Estadística Aplicada (2019)

Seminario

Análisis de los métodos de estimación de curvas de rendimiento en la deuda soberana aplicados en

Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Centro Universitario Regional del Este

V Jornadas Argentinas de Econometría (2019)

Congreso

Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana

Argentina

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Universidad de Buenos Aires

Seminario Instituto de Estadística (2019)

Seminario

Modelos estadísticos y estocásticos en curvas de rendimientos

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario Instituto de Economía (2019)

Seminario

Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. Caso de estudio: Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Taller Interdisciplinario en Sistemas Complejos (2019)

Taller

Dependencia de Largo Alcance en Series Financieras

Argentina

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Universidad de Buenos Aires

Coloquio Ur uguayo de Matemática (2019)

Congreso

Análisis dinámico de la deuda soberana

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Seminario Grupo de Investigación en Dinámica Económica (2019)

Seminario

Modelos estadísticos y estocásticos en curvas de rendimientos

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Grupo de Estudio Estadística en el Deporte (2019)

Taller

How to improve a team position in the FIFA ranking? A simulation study

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Big and Complex Data Theory, Applications and Value Creation (2018)

Congreso

Yield Curve Modelling in emerging markets: Uruguay case study

Uruguay

Tipo de participación: Poster

Nombre de la institución promotora: Information and Communication Technologies for Verticals Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Seminario Departamento de Economía (2018)

Seminario

Modelos estocásticos en tasas de interés

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Sociales

IV Jornadas de Estadística Aplicada (2017)

Encuentro

Las bondades del filtro de Kalman

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Modelización y Análisis de Recursos Naturales Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

III Jornadas Argentinas de Econometría (2016)

Seminario

Análisis Espectral del Mercado Laboral en Uruguay

Argentina

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 16 Palabras Clave: Análisis Espectral

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Second International Congress on Actuarial Science and Quantitative Finance (2016)

Congreso

Modeling the Uruguayan Sovereign Debt

Colombia

Tipo de participación: Expositor oral Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Imaginary Congress 2016 (2016)

Congreso

Mathematical education TV program

Alemania

Tipo de participación: Expositor oral Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Difusión

III Jornadas de Estadística Aplicada (2015)

Seminario

Tasas de interés y volatilidad implícita

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 16 Palabras Clave: Interest Rate

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Grupo de Estudio de Educación Matemática (2015)

Taller

Introducción al libro: Mathematical problem solving -- Alan Schoenfeld

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 2

Nombre de la institución promotora: Centro de Matemática Palabras Clave: Educación Matemática

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Ciencias Sociales / Psicología / Psicología especial

Research in Options (2014)

Congreso

Dynamic modeling of interest rate for the Uruguayan debt

Brasil

Tipo de participación: Poster

Carga horaria: 5

Nombre de la institución promotora: Instituto de Matemática Pura y Aplicada Palabras Clave:

Dynamic Modeling, Interest Rate.

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Deuda Soberana

II Jornadas de Estadística Aplicada (2014)

Seminario

Tasas de interés y volatilidad implícita.

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 5

Nombre de la institución promotora: Laboratorio de Probabilidad y Estadística de la Facultad de Ingeniería -- Polo de Desarrollo Universitario Modelización y Análisis de Recursos Naturales

Palabras Clave: Tasas de interés. Volatilidad Implícita

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Cálculo Estocástico Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Tasa de Interés

XXVIII Jornadas Anuales de Economía (2013)

Congreso

Modelo Macroeconómico del Riesgo de Crédito en Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: Modelo de

Crédito de un factor

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelo de Riesgo de Crédito

XXVII Jornadas Anuales de Economía (2012)

Congreso

Riesgo Cambiario Crediticio: Medidas e Implicaciones

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: Riesgo Cambiario Crediticio

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Riesgo de Mercado

Seminario de Gestión Bancaria (2012)

Seminario

Mercados de Derivados: Métodos de Valuación de Instrumentos Financieros

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Sociales Palabras Clave: Mercado de

Derivados

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Derivados Financieros

Seminario de Finanzas (2011)

Seminario

Valuación de opciones en Mercados Incompletos

España

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Universidad Autónoma de Madrid Areas de conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Research in Options (2010)

Congreso

Valuación de opciones en Mercados Incompletos

Brasi

Tipo de participación: Otros

Nombre de la institución promotora: Instituto Nacional de Matemática Pura y Aplicada Palabras

Clave: Valuacion de Opciones

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Mercado Financieros

Jornadas de Ingeniería Matemática (2010)

Otra

Transformada de Fourier aplicada a Mercados Incompletos

Uruguay

Tipo de participación: Poster

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ingeniería Palabras Clave: Transformada de

Fourier

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Información adicional

Indicadores de producción

PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA	24
Artículos publicados en revistas científicas	14
Completo	14
Trabajos en eventos	1
Libros y Capítulos	2
Capítulos de libro publicado	2
Textos en periódicos	2
Revistas	2
Documentos de trabajo	5
Completo	5
EVALUACIONES	7
Evaluación de publicaciones	3
Jurado de tesis	4
FORMACIÓN RRHH	1
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas	1
Tesis de maestria	1