



Curriculum Vitae

Ernesto MORDECKI PUPKO

Actualizado: 12/05/2016



Publicado: 20/07/2017

Sistema Nacional de Investigadores
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas
Categorización actual: Nivel III
Ingreso al SNI: Activo(01/03/2009)

Datos generales

Información de contacto

E-mail: ernesto.mordecki@gmail.com

Teléfono: 5252522 int 122

Dirección: Facultad de Ciencias. Centro de Matematica. Iguá 4225. CP 11400 - Montevideo - Uruguay

URL: www.cmat.edu.uy/~mordecki

Institución principal

Centro de Matemática / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Universidad de la República / Uruguay

Dirección institucional

Dirección: Facultad de Ciencias - UDeLaR / Centro de Matemática / Iguá 4225 / 11400 / Montevideo / Montevideo / Uruguay

Teléfono: (+598) 25252522

Fax: 25220653

E-mail/Web: mordecki@cmat.edu.uy / <http://www.cmat.edu.uy/~mordecki>

Formación

Formación concluida

Formación académica/Titulación

Posgrado

1991 - 1994

Doctorado

Physics and Mathematics

Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences , Rusia

Título: Convergencia de experimentos estadísticos y procesos de Hellinguer (en ruso)

Tutor/es: Albert Nicolaievich Shiryaev

Obtención del título: 1994

Becario de: Russian Academy of Sciences , Rusia

Palabras clave: Procesos Estocásticos; Estadística

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos Estocásticos

1989 - 1990

Maestría

Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Facultad de Ciencias - UDeLaR, Universidad de la República , Uruguay

Título: Teorema Central del Límite para Martingalas Fuertes Biparamétricas

Tutor/es: Enrique Mario Cabaña

Obtención del título: 1990

Becario de: Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas , Uruguay

Palabras clave: Convergencia de Procesos Estocásticos; Martingalas

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Grado

1985 - 1989	Grado Licenciatura en Matemática Facultad de Ciencias - UDeLaR, Universidad de la República , Uruguay <i>Título:</i> Monografía I: Estimación de densidades mediante series. Monografía II: Estimación de densidades mediante splines <i>Tutor/es:</i> Ricardo Fraiman <i>Obtención del título:</i> 1989 <i>Palabras clave:</i> Matematica <i>Areas del conocimiento:</i> Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística
1980 - 1985	Grado Bachiller en Ciencias Básicas de Ingeniería Facultad de Ingeniería - UDeLaR, Universidad de la República , Uruguay <i>Título:</i> No tiene tesis <i>Obtención del título:</i> 1985 <i>Palabras clave:</i> Ingeniería; Matematica; Fisica <i>Areas del conocimiento:</i> Ingeniería y Tecnología / Otras Ingenierías y Tecnologías / Otras Ingenierías y Tecnologías / Ciencias basicas de la Ingeniería

Formación complementaria

Cursos corta duración

1987 - 1987	Elementos de Análisis Funcional Instituto de Matemática Pura e Aplicada , Brasil
1986 - 1986	Métodos de Muestreo en Poblaciones Biológicas Centro Interameric Ensen Estadistica Cienes , Chile

Otras instancias

1995	Congresos <i>Nombre del evento:</i> XX Coloquio Brasileiro de Matemática <i>Institución organizadora:</i> Instituto de Matematica Pura e Aplicada , Brasil
1993	Congresos <i>Nombre del evento:</i> XIX Coloquio Brasileiro de Matemática <i>Institución organizadora:</i> Instituto de Matematica Pura e Aplicada , Brasil
1991	Simposios <i>Nombre del evento:</i> IV Simposio Soviético-Japones de Probabilidades y Estadística Matemática <i>Institución organizadora:</i> Academia de Ciencias de la URSS , Ucrania
1986	Talleres <i>Nombre del evento:</i> 2as. Jornadas Nacionales del Seminario de Probabilidad de Chile <i>Institución organizadora:</i> Universidad Catolica de Valparaiso , Chile

Construcción institucional

• Director del Centro de Matematica de la Facultad de Ciencias (Agosto 2000-Agosto 2001, Agosto 2006- Agosto 2007, Agosto 2014-Agosto 2015) • Coordinador de la Subcomision Academica de Posgrado (SCAPA) de Ingenieria Matematica, Facultad de Ingenieria (agosto de 2008 - marzo 2010) • Presidente de la Asamblea del Claustro de la Facultad de Ciencias (2002-2004) • Coordinador por Uruguay del Eje "Probabilidad y Estadística" del Instituto Franco-Uruguayo de Matemática (IFUM, 2012-)

Idiomas

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

Áreas de actuación

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

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

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

Actuación Profesional

Cargos desempeñados actualmente

Desde: 12/2007

Profesor Titular, (Docente Grado 5 Titular, 40 horas semanales / Dedicación total), Facultad de Ciencias - UDeLaR, Uruguay

Desde: 05/2013

Investigador de Primer Nivel. Grado 5, (40 horas semanales), Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas, Uruguay

Universidad de la República, Facultad de Ciencias - UDeLaR, Uruguay

Vínculos con la institución

12/2007 - Actual, *Vínculo:* Profesor Titular, Docente Grado 5 Titular, (40 horas semanales / Dedicación total)

01/1998 - 12/2007, *Vínculo:* Profesor Agregado, Docente Grado 4 Titular, (40 horas semanales / Dedicación total)

01/1990 - 12/1997, *Vínculo:* Profesor Adjunto, Docente Grado 3 Titular, (20 horas semanales)

01/1987 - 12/1989, *Vínculo:* Ayudante, Docente Grado 1 Interino, (20 horas semanales)

Actividades

08/2008 - 03/2010

Dirección y Administración, Universidad de la República, Facultad de Ingeniería

Coordinador de la SCAPA de la maestría de Ingeniería Matemática

07/2000 - 07/2001

Dirección y Administración, Centro de Matemática

Director del Centro de Matemática de la Facultad de Ciencias

07/1995 - Actual

Líneas de Investigación, Centro de Matemática, Área de Probabilidad y Estadística

Optimización en procesos Estocásticos y aplicaciones en Finanzas, Coordinador o Responsable

01/2004 - 12/2004

Docencia, Grado

Introducción a la Probabilidad y Estadística, Licenciatura en Matemática

01/2003 - 12/2003

Docencia, Grado

Cálculo Diferencial e Integral I, Licenciatura en Matemática

01/2003 - 12/2003

Docencia, Grado

Cálculo Diferencial e Integral II, Licenciatura en Matemática

01/2002 - 12/2002

Docencia, Grado

Cálculo Diferencial e Integral I, Licenciatura en Matemática

01/2002 - 12/2002

Docencia, Grado

Cálculo Diferencial e Integral II, Licenciatura en Matemática

01/2001 - 12/2001

Docencia, Grado

Introducción a la probabilidad y estadística, Licenciatura en Matemática

01/2000 - 12/2000

Docencia , Grado

Matemática II , Licenciatura en Matemática

01/2000 - 12/2000

Docencia , Grado

Probabilidad II , Licenciatura en Matemática

01/1999 - 12/1999

Docencia , Grado

Álgebra Lineal II , Licenciatura en Matemática

01/1999 - 12/1999

Docencia , Grado

Introducción a la Probabilidad y Estadística , Licenciatura en Matemática

01/1998 - 12/1998

Docencia , Grado

Cálculo diferencial e integral I , Licenciatura en Matemática

01/1998 - 12/1998

Docencia , Grado

Introducción al Análisis Real , Licenciatura en Matemática

01/1997 - 12/1997

Docencia , Grado

Inferencia III , Licenciatura en Matemática

01/1997 - 12/1997

Docencia , Grado

Probabilidad II , Licenciatura en Matemática

01/1996 - 12/1996

Docencia , Grado

Inferencia III , Licenciatura en Matemática

01/1995 - 12/1995

Docencia , Grado

Matemática I , Licenciatura en Matemática

01/1995 - 12/1995

Docencia , Grado

Estadística de procesos , Licenciatura en Matemática

01/1990 - 12/1990

Docencia , Grado

Cálculo diferencial e integral II , Licenciatura en Matemática

01/1990 - 12/1990

Docencia , Grado

Matemática para Biología , Licenciatura en Ciencias Biológicas

01/1988 - 12/1988

Docencia , Grado

Análisis Matemático I , Licenciatura en Matemática

01/1990 - 12/1990

Servicio Técnico Especializado , Centro de Matemática

Diseño de muestreo para relevamiento sobre la situación de la salud en un complejo de Viviendas, contratado por EMAUS

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

01/1989 - 12/1989

Servicio Técnico Especializado , Centro de Matemática

Proposición de un método automático de conteo de centros en zonas, para la confección de un mapa electrónico de Montevideo, contratado por la empresa MAPINFO, y el Economista Ariel Scarone

01/1998 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Dirección de trabajos de pasaje de curso de Licenciatura y Magister en Matemática de: Aspirot, L; Carrasco, H; Cuitiño, E; Gutierrez, C; Niche, C; Spallanzani

01/1991 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Miembro del Institute for Mathematical Statistics (IMS)

01/1991 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Miembro de la American Mathematical Society (AMS)

01/1990 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Referee de: J. Statistical Physics, Math.Finance, Pub.Matem. Uruguay, Quantitative Finance, Stochastic Processes and Their Applic., Theory of Probability and Applic.

01/1990 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Referee de: A.Científ.Venezolana, Ann. App. Probability, Finance and Stochast., J. of Actuarial Practice, J. of App.Probability, J. Computational Finance

01/2003 - 12/2003

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Integrante del Comité Latinoamericano de la Sociedad Bernoulli

01/2001 - 12/2001

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Integrante de la Comisión Directiva de la Sociedad Uruguaya de Matemática y Estadística - SUME

01/2000 - 12/2000

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Evaluador de proyectos de la Comisión Sectorial de Enseñanza (CSE)

01/1999 - 12/1999

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Evaluador de proyectos de la Comisión Sectorial de Investigación Científica (CSIC)

01/1997 - 12/1999

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Integrante de la Comisión Directiva de la Asociación Uruguaya para la Ciencia, la Tecnología y el Desarrollo (AUCTYD)

01/1995 - 12/1995

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Diseño de una encuesta en el conjunto de los visitantes médicos en la ciudad de Buenos Aires, contratado por la Empresa 'Eclipse' (Nelson Ferrer Producciones)

01/1991 - 12/1995

Otra actividad técnico-científica relevante , Centro de Matemática

Revisor de artículos en: Referativni Zhurnal, Mathematical Reviews

01/1990 - 12/1990

Otra actividad técnico-científica relevante , Laboratorio de Estadística

Clasificación no paramétrica de pacientes con hidatidosis.

01/1989 - 12/1989

Otra actividad técnico-científica relevante , Laboratorio de Estadística

Comparación de métodos de crecimiento de hongos. Laboratorio de Estadística

01/2003 - Actual

Gestión Académica , Centro de Matemática

Coordinador de la Comisión de Informática del Centro de Matemática

01/2004 - 12/2004

Gestión Académica

Secretario de la Asamblea del Claustro

01/2002 - 12/2004

Gestión Académica

Presidente de la Asamblea del Claustro

01/1997 - 12/2003

Gestión Académica , Centro de Matemática

Delegado docente a la Comisión Directiva del Centro de Matemática

01/1998 - 12/2001

Gestión Académica , Centro de Matemática

Delegado de la Facultad de Ciencias al Consejo Académico de la Licenciatura en Estadística

01/2000 - 12/2000

Gestión Académica , Comisión de Enseñanza

Delegado docente a la Comisión de Enseñanza

01/2002 - 12/2003

Proyectos de Investigación y Desarrollo , Centro de Matemática

Análisis estocástico, Campos aleatorios, y aplicaciones

01/1996 - 12/1999

Proyectos de Investigación y Desarrollo , Centro de Matemática

Modelos Estocásticos en Finanzas

01/1996 - 12/1998

Proyectos de Investigación y Desarrollo , Centro de Matemática

Estudio de las trayectorias de procesos aleatorios

01/1997 - 12/1997

Proyectos de Investigación y Desarrollo , Centro de Matemática

Aproximación del tiempo local; distribución del máximo de procesos estocásticos

01/1997 - 12/1997

Proyectos de Investigación y Desarrollo , Centro de Matemática

Inversión bajo incertidumbre

Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas , Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas , Uruguay

Vínculos con la institución

01/1995 - 06/2008, *Vínculo:* Investigador de segundo Nivel, (40 horas semanales)

07/2008 - 04/2013, *Vínculo:* Investigador de Primer Nivel. Grado 4, (40 horas semanales)

05/2013 - Actual, *Vínculo:* Investigador de Primer Nivel. Grado 5, (40 horas semanales)

Actividades

06/2007 - 10/2007

Docencia , Maestría

Introducción a los procesos estocásticos , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

01/1999 - 12/1999

Docencia , Maestría

Semigrupos de operadores y procesos de Markov, (junto con Fernando Peláez) , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

01/1996 - 12/1996

Docencia , Maestría

Introduccion al Calculo Estocastico y sus aplicaciones , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

01/2006 - 12/2006

Docencia , Doctorado

Introduccion al Calculo Estocastico y sus aplicaciones , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

01/2004 - 12/2004

Docencia , Doctorado

Introduccion al Calculo Estocastico y sus aplicaciones , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

01/2001 - 12/2001

Docencia , Doctorado

Introduccion a los procesos estocasticos

01/1999 - Actual

Otra actividad técnico-científica relevante , Area Matemática

Dirección de Tesis

01/1997 - 12/2003

Gestión Académica , Area Matemática

Integrante de la Comisión del Posgrado del Centro de Matemática

01/1987 - 12/1990

Gestión Académica , Comisión Directiva

Integrante de la Delegación Universitaria en la Primer Comisión Directiva del PEDECIBA

Pont Univ Catolica de Chile , Pont Univ Catolica de Chile , Chile

[Vínculos con la institución](#)

01/1991 - 12/1991, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/1991 - 12/1991

Pasantías , Facultad de Matemáticas , Departamento de Matemática

x

Univ de Chile , Chile

[Vínculos con la institución](#)

01/1995 - 12/1995, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/1995 - 12/1995

Pasantías , Departamento de Ingeniería

x

Universidad Autonoma de Madrid , Universidad Autonoma de Madrid , España

[Vínculos con la institución](#)

01/1995 - 12/1997, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/1997 - 12/1997

Pasantías

x

01/1995 - 12/1995

Pasantías

x

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Instituto de Matemática Pura e Aplicada , Instituto de Matemática Pura e Aplicada , Brasil

Vínculos con la institución

01/1996 - 12/1996, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/1996 - 12/1996

Pasantías

x

Universite de Toulouse III (Paul Sabatier) , Universite de Toulouse III (Paul Sabatier) , Francia

Vínculos con la institución

01/2000 - 12/2000, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/2000 - 12/2000

Pasantías , Laboratorio de Estadística y Probabilidad

x

Universidade de São Paulo , Universidade de São Paulo , Brasil

Vínculos con la institución

01/2004 - 12/2004, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

Actividades

01/2004 - 12/2004

Pasantías , Instituto de Matemática y Estadística

x

Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences , Rusia

Vínculos con la institución

01/2002 - 12/2002, *Vínculo:* Pasante, (40 horas semanales)

02/1991 - 12/1994, Vínculo: Estudiante de Doctorado, (40 horas semanales / Dedicación total)

Actividades

01/2002 - 12/2002

Pasantías

x.

Universidad de la República , Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay

Vínculos con la institución

01/1986 - 12/1990, *Vínculo:* Asistente interino, Docente Grado 1 Interino, (40 horas semanales)

01/1982 - 12/1986, *Vínculo:* Ayudante interino, Docente Grado 1 Interino, (20 horas semanales)

01/1990 - 12/1996, *Vínculo:* Profesor adjunto (efectivo), Docente Grado 1 Interino, (40 horas semanales)

Actividades

01/1996 - 12/1996

Docencia , Grado

Análisis I , Ingeniería Civil

01/1995 - 12/1995

Docencia , Grado

Álgebra lineal I , Ingeniería Civil

01/1995 - 12/1995

Docencia , Grado

Análisis II , Ingeniería Civil

01/1990 - 12/1990

Docencia , Grado

Algebra lineal , Ingeniería Civil

01/1996 - 06/1996

Docencia , Maestría

Procesos estocásticos , Maestría en Ingeniería Eléctrica

01/1990 - 12/1990

Servicio Técnico Especializado

Estudio de contaminación de playas, en el marco del convenio Intendencia de Montevideo

01/1998 - 12/1998

Otra actividad técnico-científica relevante

Discusión y proposición de un modelo estadístico para la determinación de la 'Máxima ola cincuentenaria' en el diseño de puertos en colaboración con el IMFIA

07/2008 - Actual

Gestión Académica , Instituto de Matemática y Estadística

Coordinador de la Subcomisión Académica de Posgrado en Ingeniería Matemática

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

[Vínculos con la institución](#)

01/1997 - 12/1997, *Vínculo:* Profesor titular (efectivo), Docente Grado 5 Titular, (40 horas semanales)

Actividades

01/1997 - 12/1997

Docencia , Grado

Matemática I , Contador Público

Osaka University , Japón

[Vínculos con la institución](#)

07/2008 - 07/2008, *Vínculo:* Profesor visitante, (40 horas semanales)

City University of Hong Kong , Hong Kong

[Vínculos con la institución](#)

06/2006 - 07/2006, *Vínculo:* Visiting Fellow, (40 horas semanales)

02/2007 - 03/2007, *Vínculo:* Visiting Fellow, (40 horas semanales / Dedicación total)

06/2008 - 07/2008, *Vínculo:* Visiting Fellow, (40 horas semanales)

06/2010 - 07/2010, *Vínculo:* Lecturer, (40 horas semanales)

Actividades

06/2007 - 07/2007

Líneas de Investigación , Department of Mathematics

Flocking in Noisy environment , Coordinador o Responsable

06/2008 - 07/2008

Docencia , Maestría

Statistics and calibration in Finance and Insurance

02/2007 - 03/2007

Docencia , Maestría

Statistics and calibration in Finance and Insurance

06/2006 - 07/2006

Docencia , Maestría

Statistics and calibration in Finance and Insurance

Abo Akademi , Finlandia

Vínculos con la institución

02/2005 - 06/2005, *Vínculo:* Visiting Professor, (40 horas semanales / Dedicación total)

08/2015 - 09/2015, *Vínculo:* , (40 horas semanales)

Actividades

02/2005 - 06/2005

Líneas de Investigación , Department of Mathematics

Optimal stopping of Hunt Processes , Coordinador o Responsable

Lineas de investigación

Título: Flocking in Noisy environment

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Equipos: Cucker(Integrante)

Palabras clave: Flocking

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Complex Systems

Título: Optimal stopping of Hunt Processes

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Equipos: Paavo Salminen(Integrante)

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Título: Optimización en procesos Estocásticos y aplicaciones en Finanzas

Tipo de participación: Coordinador o Responsable

Objetivo: Se trata de problemas de parada óptima y probabilidades de ruina en procesos de Levy. Se aplican en el contexto de las Finanzas y la matemática actuarial.

Equipos: Federico de Olivera(Integrante); Fabián Croce(Integrante); José Fajardo(Integrante)

Palabras clave: Opciones Americanas; Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Matematica Financiera

Proyectos

1997 - 1997

Título: Aproximación del tiempo local; distribución del máximo de procesos estocásticos, *Descripción:* Proyecto de cooperación entre Francia y Uruguay

Tipo: Investigación

Alumnos:

Equipo: Mario Wschebor(Responsable)

Financiadores: Institución del exterior / Evaluation-orientation de la Coopération scientifique / Apoyo financiero

1997 - 1997

Título: Inversión bajo incertidumbre,

Tipo: Investigación

Alumnos:

Financiadores: DINACYT/DICYT/CONICYT / Apoyo financiero

Fondo Clemente Estable CONICYT / Apoyo financiero

1996 - 1998

Título: Estudio de las trayectorias de procesos aleatorios,

Tipo: Investigación

Alumnos:

Equipo: Mario Wschebor(Responsable)

Financiadores: DINACYT/DICYT/CONICYT / Apoyo financiero

1996 - 1999

Título: Modelos Estocásticos en Finanzas,

Tipo: Investigación

Alumnos:

Financiadores: DINACYT/DICYT/CONICYT / Apoyo financiero

Consejo Nacional de Innovación Ciencia y Tecnología y B I D / Apoyo financiero

2002 - 2003

Título: Análisis estocástico, Campos aleatorios, y aplicaciones, *Descripción:* co- responsable

Tipo: Investigación

Alumnos:

Financiadores: Comisión Sectorial de Investigación Científica - UDeLaR / Apoyo financiero

Producción científica/tecnológica

El area de trabajo podria denominarse 'procesos estocasticos y aplicaciones'. Mis primeros trabajos, relacionados con la tesis doctoral, tratan de estadistica de procesos aleatorios. Alli se obtuvieron resultados de Convergencia de procesos de verosimilitud del tipo Local Asymptotical Mixed Normality (LAMN) en terminos de las características previsible de los procesos estocasticos involucrados. A lo largo de mi carrera he seguido trabajando tambien en temas de estadistica de procesos aleatorios. Un segundo tema de interes es la parada optima de procesos y su aplicacion en finanzas. Alli obtuve resultados para las opciones integrales, y luego para los procesos de Levy. Relacionado con este tema, obtuve formulas explicitas para la probabilidad de ruina (que es equivalente a la distribucion del maximo) para diversas clases de procesos de Levy. Me he interesado tambien por el calculo numerico para ecuaciones diferenciales estocasticas. Con varios estudiantes de maestria hemos trabajado con datos financieros: en petroleo con el objetivo de valorar seguros ante variacion de precios; en cotizaciones de tipo de cambio, para cuantificar el riesgo del tipo de cambio; en la evolucion del indice SP500 con el objetivo de obtener modelos de valuacion de opciones que combinen la informacion historica y la de riesgo neutral. Me interesa tambien la modelacion estadistica en telecomunicaciones, el analisis de sistemas de gran tamaño y los modelos limites que se obtienen, asi como las velocidades de aproximacion de esta modelacion (aproximaciones debiles y grandes desvios). Mas recientemente comence a trabajar en modelacion estocastica de estilos musicales, y en problemas de complejidad algoritmica.

Producción bibliográfica

Artículos publicados

Arbitrados

Completo

E. CANALE; DALMAO, F.; MORDECKI, E.; M. O. SOUZA

Robustness of Cucker-Smale flocking model. IET Control Theory and Applications, v.: 9 3, p.: 346 - 350, 2015

Areas del conocimiento: Ingeniería y Tecnología / Ingeniería Eléctrica, Ingeniería Electrónica e Ingeniería de la Información / Control Automático y Robótica / Control Distribuido

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 17518644 ; DOI: 10.1049/iet-cta.2014.0496



Completo

MORDECKI, E.; DALMAO, F.

Rice Formula for processes with jumps and applications. *Extremes*, v.: 18 1, p.: 15 - 35, 2015

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 13861999 ; DOI: 0.1007/s10687-014-0200-2



SCOPUS



Completo

FAJARDO, J.; MORDECKI, E.

Skewness premium with Lévy processes. *Quantitative Finance*, v.: 14 9, p.: 1619 - 1626, 2014

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 14697688 ; DOI: 10.1080/14697688.2011.618809

<http://www.tandfonline.com/doi/abs/10.1080/14697688.2011.618809>



SCOPUS



Completo

Sistema Nacional de Investigadores

ANTONIE LEJAY; MORDECKI, E.; SOLEDAD TORRES

Is a Brownian Motion Skew?. *Scandinavian Journal of Statistics*, v.: 41 2, p.: 346 - 364, 2014

Palabras clave: Skew Brownian Motion

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 03036898 ; DOI: 10.1111/sjos.12033

<http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1111/sjos.12033/abstract>



SCOPUS



Completo

CROCCE, F.; MORDECKI, E.

Explicit solutions in one-sided optimal stopping problems for one-dimensional diffusions. *Stochastics An International Journal of Probability and Stochastic Processes*, v.: 86 3, p.: 491 - 509, 2014

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 17442508 ; DOI: 10.1080/17442508.2013.837467

<http://www.tandfonline.com/doi/abs/10.1080/17442508.2013.837467#.U8Z7Oaingy4>



SCOPUS



Completo

MORDECKI, E.; ALEJANDRO PENA; ANDRES SOSA

Exchange Credit Risk: Measurement and Implications on the stability of partially dollarized financial systems.. *Risk Governance & Control: Financial Markets & Institutions*, v.: 3, p.: 58 - 72, 2013

Palabras clave: Credit Risk

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Riesgo de credito

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 20774303

Completo

MORDECKI, E.; ALEJANDRO PENA; ANDRES SOSA

Characterization and estimation of exchange credit risk in partially-dollarized economies. *Revista de Economía*, v.: 20 2, p.: 61 - 91, 2013

Palabras clave: Finanzas

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Uruguay ; ISSN: 07975546

Completo

MORDECKI, E.; DALMAO, F.

Hierarchical Cucker-Smale model subject to random failure. IEEE Transactions on Automatic Control, v.: 57 7, p.: 1789 - 1793, 2012

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Flocking

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00189286

<http://www.nd.edu/~ieeetac/>



Completo

DALMAO, F.; MORDECKI, E.

Cucker–Smale Flocking Under Hierarchical Leadership and Random Interactions. SIAM Journal on Applied Mathematics, v.: 71 4, p.: 1307 - 1316, 2011

Palabras clave: Flocking; Dynamical System; Random noise

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Control

Medio de divulgación: Papel ; Lugar de publicación: EEUU ; ISSN: 00361399 ; DOI: 10.1137/100785910

<http://dx.doi.org/10.1137/100785910>



Sistema Nacional de Investigadores 

Completo

MORDECKI, E.; FAJARDO, J.

Market symmetry in time-changed Brownian models . Finance Research Letters , v.: 7 1, p.: 53 - 59, 2010

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 15446123 ; DOI: 10.1016/j.frl.2009.11.003

<http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S1544612309000580>



Completo

CUCKER, F.; MORDECKI, E.

Flocking in noisy environments. Journal de Mathématiques Pures et Appliquées, v.: 89 3, p.: 278 - 296, 2008

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Sistemas Complejos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00217824 ; Idioma/Pais: Inglés/Francia

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/articles/>



Completo

MORDECKI, E.; SZEPESSY, A.; TEMPONE, R.; ZOURARIS, G.

Adaptive Weak Approximation of Diffusions with Jumps. SIAM Journal on Numerical Analysis, v.: 46 4, p.: 1732 - 1768, 2008

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Análisis Numérico

Medio de divulgación: Papel ; Lugar de publicación: Estados Unidos ; ISSN: 00361429 ; Idioma/Pais: Inglés/Estados Unidos

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/articles/>



Completo

LEWIS, A.; MORDECKI, E.

Wiener-Hopf factorization for Levy processes having negative jumps with rational transforms . Advances in Applied Probability, v.: 45 1, p.: 118 - 134, 2008

Palabras clave: Procesos de Levy

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos de Lévy

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Sheffield ; *ISSN:* 00018678 ; *Idioma/Pais:* Inglés/Gran Bretaña



SCOPUS

Completo

MORDECKI, E.; FAJARDO, J.

Duality and Symmetry with Time-Changed Levy processes. Brazilian Journal of Econometrics, v.: 28 1, p.: 95 - 110, 2008

Palabras clave: Finanzas

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Rio de Janeiro ; *ISSN:* 19802447

<http://www.sbe.org.br>

Completo

MORDECKI, E.; SALMINEN, P.

Optimal Stopping of Hunt and Levy Processes . Stochastics and Stochastics Reports, v.: 79 3-4, p.: 233 - 251, 2007

Palabras clave: Optimal stopping; Hunt Processes

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Great Britain ; *ISSN:* 10451129 ; *Idioma/Pais:* Inglés/Gran Bretaña

Completo

MORDECKI, E.; FAJARDO, J.

Pricing Derivatives on Two Dimensional Levy Processes. International Journal Of Theoretical And Applied Finance, v.: 9 2, p.: 185 - 197, 2006

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Finanzas Matemáticas

Medio de divulgación: Papel ; *ISSN:* 02190249 ; *Idioma/Pais:* Español/Estados Unidos

SCOPUS

Completo

FAJARDO, J.; MORDECKI, E.

Symmetry and Duality in Levy Markets. Quantitative Finance, v.: 6 3, p.: 219 - 227, 2006

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; *ISSN:* 14697688 ; *Idioma/Pais:* Inglés/Gran Bretaña



SCOPUS

Completo

MORDECKI, E.; WSCHEBOR, M

Smoothing the paths and weak approximation of the occupation measure of Levy processes. Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 11, p.: 23 - 40, 2006

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Montevideo ; *ISSN:* 07971443 ; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay

Completo

MORDECKI, E.; WSCHEBOR, M.

Approximation of the occupation measure of Levy processes . Comptes Rendus de L'Academie des Sciences Serie III-Sciences de la Vie-Life Sciences, v.: 340, p.: 605 - 610, 2005

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos

Medio de divulgación: Papel ; *ISSN:* 07644469 ; *Idioma/Pais:* Inglés/Francia

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

SEVEROV, D.; MORDECKI, E.; PSHENNIKOVA, V.

SST anomaly variability in Southwestern Atlantic and El Nino/Southern oscillation. *Advances in Space Research*, v.: 33, p.: 343 - 347, 2004

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Tierra y relacionadas con el Medio Ambiente / Investigación Climatológica

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 02731177 ; Idioma/Pais: Inglés/Holanda



Completo

MORDECKI, E.

Ruin probabilities for a Levy process with mixed exponential negative jumps. *Theory of Probability and its Applications*, v.: 48, p.: 188 - 194, 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos de Lévy

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 0040585X ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia



Completo

MORDECKI, E.

Sistema Nacional de Investigadores

Optimal stopping and perpetual options for Levy processes. Finance and Stochastics, v.: 6 4, p.: 473 - 493, 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 09492984 ; DOI: 10.1007/s007800200070 ; Idioma/Pais: Inglés/Estados Unidos

<http://www.springerlink.com/content/wxpdhe5auu82wlmn/>



Completo

GUSHCHIN, A. A.; MORDECKI, E.

Bounds on option prices for semimartingale market models. *Proceedings of the Steklov Institute of Mathematics*, v.: 237, p.: 80 - 122, 2002

Palabras clave: Statistical Experiments; Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00815438 ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia

Completo

MORDECKI, E.

Perpetual Options for Levy Processes in the Bachelier Model. *Proceedings of the Steklov Institute of Mathematics*, v.: 237, p.: 256 - 264, 2002

Palabras clave: Parada óptima; Procesos de Levy

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00815438 ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia

Sistema Nacional de Investigadores

Completo

MORDECKI, E.

The distribution of the maximum of a Levy processes with positive jumps of phase-type. *Theory of Stochastic Processes*, v.: 8 24 3-4, p.: 309 - 316, 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos de Lévy

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 03213900 ; Idioma/Pais: Inglés/Ucrania

Completo

MORDECKI, E.; WALTER MOREIRA

Russian Options for a Difussion with Negative Jumps. *Publicaciones Matemáticas Del Uruguay*, v.: 9, p.: 37 - 51, 2001

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 07971443 ; Idioma/Pais: Español/Uruguay

Completo

MORDECKI, E.

Necessary conditions for stable convergence of semimartingales. Theory of Probability and its Applications, v.: 44 1, p.: 229 - 232, 1999

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Convergencia débil de procesos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 0040585X ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia



Completo

MORDECKI, E.

Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps. Finance and Stochastics, v.: 2, p.: 227 - 238, 1999

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 09492984 ; Idioma/Pais: Inglés/Suiza

Completo

MORDECKI, E.; KRAMKOV, D.

Optimal stopping and Maximal Inequalities for Poisson Processes. Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 8, p.: 153 - 178, 1999

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 07971443 ; Idioma/Pais: Español/Uruguay

Completo

MORDECKI, E.

Optimal Stopping Rules for Compound Poisson Processes. Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 7, p.: 55 - 66, 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 07971443 ; Idioma/Pais: Español/Uruguay

Completo

MORDECKI, E.

Asymptotic mixed normality and Hellinger Processes. Stochastics and Stochastics Reports, v.: 48, p.: 129 - 143, 1994

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 10451129 ; Idioma/Pais: Inglés/Inglaterra

Completo

MORDECKI, E.; KRAMKOV, D.

Integral Option. Theory of Probability and its Applications, v.: 39 1, p.: 201 - 210, 1994

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 0040585X ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia



Completo

MORDECKI, E.

Necessary Conditions for Stable Convergence of Semimartingales. Russian Mathematical Surveys, v.: 48, p.: 193 - 194, 1993

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Convergencia débil de procesos

Medio de divulgación: Papel ; ISSN: 00360279 ; Idioma/Pais: Inglés/Rusia



Completo

MORDECKI, E.

Convergence of Binary Statistical Experiments and Hellinguer Processes. Russian Mathematical Surveys, v.: 47, p.: 223 - 224, 1992

Palabras clave: Estadística de procesos aleatorios

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Moscú ; *ISSN:* 00360279 ; *Idioma/País:* Inglés/Rusia



Artículos aceptados

Arbitrados

Completo

CROCCE, F.; MORDECKI, E.

A finite exact algorithm to solve a dice game. Journal of Applied Probability, 2016

Palabras clave: Procesos de Markov Controlados

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Control Estocástico

Medio de divulgación: Papel ; *Lugar de publicación:* Australia ; *ISSN:* 00219002

<http://www.appliedprobability.org/>



Completo

MORDECKI, E.; DE OLIVERA, F.

Computing Greeks for Levy Models: The Fourier Transform Approach. Springer Proceedings in Mathematics and Statistics, 2016

Palabras clave: Valuación de opciones

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; *ISSN:* 21941009

Completo

MORDECKI, E.; ANDRÉS SOSA

Modeling the Uruguayan debt through gaussian models. Springer Proceedings in Mathematics and Statistics, 2016

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel ; *ISSN:* 21941009

Libros

Libro publicado , Texto integral

A. ABELLA; MORDECKI, E.

Calculo diferencial e integral con funciones de varias variables. 2015. *Número de volúmenes:* 1, *Nro. de páginas:* 168, *Edición:* 1,

Editorial: Dirac - Facultad de Ciencias , Montevideo

Palabras clave: FUNCIONES DE VARIAS VARIABLES; CALCULO DIFERENCIAL; CALCULO INTEGRAL

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Cálculo diferencial e integral

Medio de divulgación: Papel; *ISSN/ISBN:* 9789974012448;

Financiación/Cooperación: Facultad de Ciencias - UDeLaR / Apoyo financiero

Libro compilado , Libro

MORDECKI, E.; MARKARIAN, R.

Jose Luis Massera: Ciencia y compromiso social. 2010. *Número de volúmenes:* 800, *Nro. de páginas:* 364, *Edición:* 1,

Editorial: Orbe Libros , Montevideo

Palabras clave: Historia de la matemática

Áreas del conocimiento: Humanidades / Filosofía, Ética y Religión / Filosofía, Historia y Filosofía de la Ciencia y la Tecnología / Matemática

Medio de divulgación: Papel; *ISSN/ISBN:* 9974661615;

Financiación/Cooperación: Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas / Apoyo financiero

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/massera/libro/>

Libro publicado , Texto integral

PETROV, V.V.; MORDECKI, E.

Teoría de la Probabilidad. 2008. *Número de volúmenes: 1, Nro. de páginas: 272, Edición: 2,*

Editorial: DIRAC- Facultad de Ciencias , Montevideo

Palabras clave: Matematica; Probabilidad; Procesos Estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; ISSN/ISBN: 9974004337;

Financiación/Cooperación: Comisión Sectorial de Investigación Científica - UDeLaR / Apoyo financiero

Segunda Edicion

Libro publicado , Texto integral

PETROV, V; MORDECKI, E.

Teoría de Probabilidades. 2002. *Número de volúmenes: 1, Nro. de páginas: 286,*

Editorial: Editorial URSS , Moscu

Palabras clave: Probabilidad; Procesos Estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; ISSN/ISBN: 5836004900;

Sistema Nacional de Investigadores

Trabajos en eventos

Completo

ASPIROT, L.; MORDECKI, E.; RUBINO, G.

Fluid Limit for the Machine Repairman Model with Phase-Type Distributions , 2013

Evento: Internacional , 10th International Conference, QEST 2013 , Buenos Aires , 2013

Anales/Proceedings: Lectures Notes in Computer Sciences , 8054 , 139 , 154Arbitrado: SI

Editorial: Springer , Nueva York

Palabras clave: Limites Fluidos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Computación e Información / Ciencias de la Computación / Limites Fluidos

Medio de divulgación: Papel;

http://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-642-40196-1_10

Completo

ASPIROT, L.; MORDECKI, E.; RUBINO, G.

Fluid Limits Applied to Peer to Peer Network Analysis , 2011

Evento: Internacional , Quantitative Evaluation of Systems (VIII QEST), 2011 , Aachen , 2011

Anales/Proceedings: 2011 Eighth International Conference on the Quantitative Evaluation of Systems , 13 , 20

Editorial: IEEE Computer Society

Palabras clave: Fluid limits

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Telecomunicaciones

Medio de divulgación: Papel;

<http://ieeexplore.ieee.org/stamp/stamp.jsp?tp=&arnumber=6042025&isnumber=6041591>

Resumen

ASPIROT, L.; MORDECKI, E.; RUBINO, G.

Fluid Limit for a Repairman Problem with Phase Type Time Distribution , 2011

Evento: Internacional , XII Latin American Congress of Probability and Mathematical Statistics , Vina del Mar , 2012

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Palabras clave: Procesos Estocasticos; Telecomunicaciones

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Telecomunicaciones

Medio de divulgación: Papel;

<http://clapem2012.mat.puc.cl/>

Esta sometida a consideración, el evento es en marzo de 2012

Resumen

MORDECKI, E.

Duality Symmetry and Skewness in Levy Markets , 2009

Evento: Regional , XI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , Naiguata , 2009

Anales/Proceedings: Programa y Resúmenes del XI CLAPEM Arbitrado: SI

Editorial: Editorial TEXTO , Caracas

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel;

<http://cipion.cesma.usb.ve/xiclapem/es/index.php>

Resumen

MORDECKI, E.

Is a Brownian motion Skew? , 2009

Evento: Internacional , XI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , Naiguata , 2009

Anales/Proceedings: Programa y Resúmenes del XI CLAPEM

Editorial: Editorial TEXTO , Caracas

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de procesos aleatorios

Medio de divulgación: Internet;

<http://cipion.cesma.usb.ve/xiclapem/es/index.php>

Completo

FAJARDO, J.; MORDECKI, E.

A note on Pricing, Duality and Symmetry for Two Dimensional Lévy Processes , 2006

Evento: Internacional , Second Bachelier Colloquium on Stochastic Calculus and Finance , Metabief , 2005

Anales/Proceedings: From Stochastic Calculus to Mathematical Finance: The Shiryaev Festschrift , 249 , 256 Arbitrado: SI

Editorial: Springer

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel; ISSN/SBN: 3540307826; Idioma/Pais: Inglés/Francia;

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/articles/>

Editores: Yu. Kabanov, R. Liptser, J. Stoyanov

Resumen

MORDECKI, E.

Put-Call duality for option prices in Lévy markets , 2002

Evento: Nacional , XVII Jornadas Anuales de Economía , Montevideo , 2002

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel; Idioma/Pais: Español/Uruguay;

Resumen

MORDECKI, E.

Pruebas elementales en parada óptima , 2001

Evento: Nacional , XVI Jornadas Anuales de Economía , 2001

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Resumen

MORDECKI, E.

Bounds on option prices and comparison of statistical experiments for semimartingales. , 2001

Evento: Internacional , Latin American and Caribbean Economic Association (LACEA) , Montevideo , 2001

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Conferencia

[Resumen](#)

[MORDECKI, E.](#)

Sistema Nacional de Investigadores

[Optimal stoppng and perpetual options for Levy processes , 2000](#)

Evento: [Internacional , First World Congress of the Bachelier Finance Society , Paris , 2000](#)

Anales/Proceedings: [Arbitrado: SI](#)

Areas del conocimiento: [Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera](#)

Medio de divulgación: [Papel; Idioma/Pais: Inglés/Francia;](#)

Resumen

MORDECKI, E.; MOREIRA, W

Opciones rusas para una difusión con saltos , 2000

Evento: Nacional , XV Jornadas Anuales de Economía , 2000

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Resumen

MORDECKI, E.; CIRIELLI, J

Un ejemplo de valuación de opciones en un modelo binomial , 1999

Evento: Nacional , XIV Jornadas Anuales de Economía , Montevideo , 1999

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Sistema Nacional de Investigadores

Resumen

MORDECKI, E.

Parada óptima para una difusión con saltos , 1998

Evento: Nacional , XIII Jornadas Anuales de Economía , Montevideo , 1998

Anales/Proceedings: Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Completo

MORDECKI, E.

Ruin Probabilities and Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps , 1997

Evento: Internacional , Fourth Congress Dr A. Monteiro , Bahı̄a Blanca , 1997

Anales/Proceedings: Proceedings of the Fourth Congress Dr A. Monteiro , 39 , 48Arbitrado: SI

Editorial: Univ. Nac. del Sur , Bahı̄a Blanca

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Argentina;

Resumen

MORDECKI, E.

Desigualdades maximales para procesos de Poisson , 1997

Evento: Nacional , Encuentro de Matemática , Montevideo , 1997

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Completo

MORDECKI, E.

Strong convergence of statistical experiments and Hellinguer Processes. , 1996

Evento: Internacional , Frontiers in Pure and Applied Probability II. 4th Finish-Russian Symposium on Probability and Mathematical Statistics , Moscow , 1996

Anales/Proceedings: Proceedings of the 4th Finish-Russian Symposium on Probability and Mathematical Statistics , 139 , 152Arbitrado: SI

Editorial: TVP Science Publishers

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Inglés/Rusia;

Resumen

MORDECKI, E.

Parada optima para un proceso con saltos , 1995

Evento: Regional , VI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , Viña del Mar , 1995

Anales/Proceedings: Anales del VI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística MatemáticaArbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Chile;

Resumen

MORDECKI, E.

Asymptotic mixed normality for branching processes. , 1993

Evento: Regional , V Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , San Pablo , 1993

Anales/Proceedings: Anales del V Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística MatemáticaArbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Inglés/Brasil;

Resumen

MORDECKI, E.; KRAMKOV, D O

Integral Option , 1993

Evento: Internacional , Simposio Ruso-Finlandes de Probabilidad y Estadística , Moscú , 1993

Anales/Proceedings: Anales del Simposio Ruso-Finlandés de Probabilidad y Estadística

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Uruguay;

Resumen

MORDECKI, E.

Central Limit Theorem for Planar Strong Martingales , 1990

Evento: Regional , IV Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , 1990

Anales/Proceedings: Anales del IV Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/México;

Resumen

MORDECKI, E.

Descomposicion de Doob-Meyer para una quasimartingala biparametrica , 1989

Evento: Regional , VIII Escuela de Invierno de Probabilidad y Estadística , Santiago , 1989

Anales/Proceedings: Anales de VIII Escuela de Invierno de Probabilidad y Estadística Arbitrado: SI

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Papel; *Idioma/Pais:* Español/Chile;

Texto en periódicos

Periodicos

MORDECKI, E.

Mario W: primer decano de la Facultad de Ciencias , la diaria , v: , p: , 2015

Medio de divulgación: Papel; *Lugar de publicación:* Montevideo;

Producción técnica

Trabajos Técnicos

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Cálculo diferencial e integral en varias variables , Notas para el curso de Calculo diferencial en integral II , 2004 , 80

Institución financiadora: UdelaR

Palabras clave: Calculo

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Funciones de varias variables

Medio de divulgación: Internet; *Disponibilidad:* Irrestricita; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/calculo2/2004/teorico/>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Probabilidad , Material de un curso de formación de docentes de secundaria , 2004 , 30 , 1

Institución financiadora: UdelaR

Palabras clave: Probabilidad

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad

Medio de divulgación: Internet; *Disponibilidad:* Irrestricita; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/probabilidad/>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Distribución del máximo de un proceso de Lévy y aplicaciones en finanzas y matemática actuarial , Notas del Curso de la I Escuela de Invierno de Análisis Estocástico y Aplicaciones. Valparaíso - Chile , 2003 , 30 , 1

Institución financiadora: Universidad de Valparaíso

Palabras clave: Procesos de Levy

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* Valparaíso/Chile

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/valparaiso/>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

On the Number of Knight's Tours , Pre-publicacion de Matemática , 2001 , 10 , 12

Institución financiadora: UdelaR

Palabras clave: Knight tours

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Combinatoria

Medio de divulgación: Papel; *Disponibilidad:* Irrestricta; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://premat.fing.edu.uy>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Elementary proofs on optimal stopping , Pre-publicacion de Matemática de la Universidad de la Republica , 2000 , 10 , 12

Institución financiadora: UdelaR

Palabras clave: Parada optima de procesos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Medio de divulgación: Papel; *Disponibilidad:* Irrestricta; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://premat.fing.edu.uy>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Optimal stopping, ruin probabilities and prophet inequalities for Lévy processes , Pre-publicacion de Matemática de la Universidad de la Republica , 2000 , 20 , 12

Institución financiadora: UdelaR

Palabras clave: Parada optima de procesos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Medio de divulgación: Papel; *Disponibilidad:* Irrestricta; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://premat.fing.edu.uy>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial , Curso en la Universidad Tecnológica Metropolitana. Santiago, Chile , 2000 , 30 , 1

Institución financiadora: Universidad Metropolitana de Santiago

Palabras clave: Procesos de Levy

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Medio de divulgación: Internet; *Disponibilidad:* Irrestricta; *Ciudad:* Santiago de Chile/Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/utem/>

Informe o Pericia técnica

MORDECKI, E.

Modelos Matemáticos en Finanzas: Valuación de Opciones. . Curso de Actualizacion Profesional , 1998 , 40 , 1

Institución financiadora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración. Universidad de la República

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel; *Ciudad:* Montevideo/Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/upae/upae-curso.ps>

Unidad de Perfeccionamiento y Actualización de Egresados (UPAE)

Otra

MORDECKI, E.

Calculo Diferencial e Integral II , 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* /Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/mordecki/courses/2calculo/>

Otra

MORDECKI, E.

Calculo Diferencial e Integral I. , 2003

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* /Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/mordecki/courses/1calculo/>

Otra

MORDECKI, E.

Calculo Diferencial e Integral II. , 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* /Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/mordecki/courses/calculo2/>

Otra

MORDECKI, E.

Calculo Diferencial e Integral I. , 2002

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* /Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/mordecki/courses/calculo1>

Otra

MORDECKI, E.

Introduccion a la Probabilidad y Estadistica , 2001

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Medio de divulgación: Internet; *Ciudad:* /Uruguay

<http://www.cmat.edu.uy/mordecki/courses/probabilidad01>

Otros

Cursos de corta duración dictados

Especialización

Levy models in Finance , 2010

México , Inglés , Internet , <http://www.cimat.mx/Eventos/ipeapye09/>

Tipo de participación: Docente, *Unidad:* Centro de Investigaciones Matematicas (CIMAT), *Duración:* 1 semanas

CIMAT , Guanajuato

Institución Promotora/Financiadora: National Science Foundation (USA)

Palabras clave: Levy Processes; Option Pricing

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Sistema Nacional de Investigadores

Cursos de corta duración dictados

Otro

Probabilidad , 2004

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Institución Promotora/Financiadora: MEC

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Curso de Actualización disciplinar en Probabilidad, dirigido a docentes de Enseñanza Secundaria, en el marco de la Transformación de la Educación Media Superior

Cursos de corta duración dictados

Otro

Distribución del máximo de un proceso de Lévy y aplicaciones en finanzas y matemática actuarial , 2003

Chile , Español

Tipo de participación: Docente,

I Escuela de Invierno de Análisis estocástico y Aplicaciones , Valparaíso

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Cursos de corta duración dictados

Otro

Limit theorems of Probability Theory II , 2002

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: A cargo del Prof. V. Petrov de la Universidad de San Petersburgo, Rusia

Cursos de corta duración dictados

Otro

Limit theorems of Probability Theory , 2000

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: A cargo del Prof. V. Petrov de la Universidad de San Petersburgo, Rusia

Cursos de corta duración dictados

Otro

Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial , 2000

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Santiago

Institución Promotora/Financiadora: Universidad Tecnológica Metropolitana

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: Jornadas de trabajo en Probabilidades

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Cursos de corta duración dictados

Otro

Statistics of Continuous time stochastic processes , 1999

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: A cargo del Profesor Alexander Gushchin del Instituto Steklov de la Academia de Ciencias de Rusia

Cursos de corta duración dictados

Otro

Modelos matemáticos en finanzas: Valuación de opciones. Curso de actualización para egresados , 1998

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Montevideo

Institución Promotora/Financiadora: UPAE, Facultad de Ciencias Económicas y Administración

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Cursos de corta duración dictados

Otro

Modelos Estocásticos en Finanzas. Curso en la Primera Escuela Uruguaya de Matemática , 1996

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Sociedad Uruguaya de Matemática y Estadística , Montevideo

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Cursos de corta duración dictados

Otro

Probabilidad y Estadística. XIX Cursos de Verano de la Universidad de la República , 1988

Uruguay , Español

Tipo de participación: Docente,

Montevideo

Institución Promotora/Financiadora: UDELAR

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Organización de eventos

Concierto

Economía Matemática en el Congreso de la Latin American and Caribbean Economic Association (LACEA) , 2001

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: Presidente de la Sección II

Organización de eventos

Congreso

7th Regional Meeting on Probability and Mathematical Statistics , 2010

Argentina , Español , <http://www.erpem2010.santafe-conicet.gov.ar/>

Duración: 1 semanas

Evento itinerante: NO, *Catálogo:* NO

Santa Fe

Institución Promotora/Financiadora: Instituto de Matemática Aplicada del Litoral. Santa Fe, Argentina

Palabras clave: Probabilidad; Estadística

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística y Probabilidad

Información adicional: Integrante del Comité Científico

Organización de eventos

Congreso

IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , 2004

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Presidente del Comité Local Organizador

Organización de eventos

Congreso

I Congreso Internacional de Matemática Aplicada a la Ingeniería y Enseñanza de la matemática en Ingeniería , 2001

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Información adicional: Integrante del Comité académico

Organización de eventos

Otro

XIV Escuela Latinoamericana de Matemática (ELAM) , 2005

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Miembro del Comité Local Organizador

Organización de eventos

Otro

Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática : Procesos de Poisson y de Wiener , 2004

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Sistema Nacional de Investigadores

Organización de eventos

Otro

Seminario de Probabilidad y Estadística de las Facultades de Ciencias Económicas, Ingeniería y Ciencias , 2004

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Organización de eventos

Otro

Cálculo estocástico y estadística para finanzas en el IX CLAPEM , 2004

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Organizador de la Sesión Especial

Organización de eventos

Otro

Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática: Cadenas Markov , 2003

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Organización de eventos

Otro

Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática: Complejidad de Kolmogorov. , 2003

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Organización de eventos

Otro

Primer Encuentro Nacional de Jóvenes Matemáticos y Estadísticos - En recuerdo de Gonzalo Pérez Iribarren , 2003

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Integrante del Comité Local Organizador

Organización de eventos

Otro

Seminario de Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática , 1999

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Sistema Nacional de Investigadores

Organización de eventos

Otro

Coloquio de Matemática , 1995

Uruguay , Español

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Otra producción técnica

Optimal Stopping for Hunt and Levy processes , 2008

Chile , Inglés , Otros , <http://ir2008.dim.uchile.cl/>

Conferencia

Santiago de Chile , Santiago de Chile

Institución Promotora/Financiadora: Centro de Modelamiento Matematico, Universidad de Chile

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Evaluaciones

Evaluación de Proyectos

2011 / 2011

Institución financiadora: Mathamsud

Cantidad: Menos de 5

Mathamsud , Paraguay

Delegado de Uruguay en el Comite de Matematica de Mathamsud

Evaluación de Proyectos

2010 / 2010

Institución financiadora: Mathamsud

Cantidad: De 5 a 20

Mathamsud , Argentina

Delegado de Uruguay en el comite de matematica del proyecto Mathamsud

Evaluación de Proyectos

2006 / 2006

Institución financiadora: Fondo Clemente Estable

Cantidad: De 5 a 20

Fondo Clemente Estable , Uruguay

Evaluación de Proyectos

2000 / 2000

Institución financiadora: Comision Sectorial de Enseñanza - UdelaR

Cantidad: Menos de 5

Comision Sectorial de Enseñanza - UdelaR , Uruguay

Evaluación de Proyectos

1999 / 1999

Institución financiadora: Comision Sectorial de Investigacion Cientifica CSIC - UdelaR

Cantidad: Menos de 5

Comision Sectorial de Investigacion Cientifica CSIC - UdelaR , Uruguay

Evaluación de Publicaciones

2012 / 2012

Nombre: Brazilian Journal of Probability and Statistics,

Cantidad: Menos de 5

Editor Asociado

Evaluación de Publicaciones

2008 / 2008

Nombre: Asymptotic Analysis ISSN: 0921-7134 ,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2008 / 2008

Nombre: Statistics and Probability Letters,

Cantidad: Menos de 5

Octubre de 2008

Evaluación de Publicaciones

2008 / 2008

Nombre: Electronic Communications in Probability,

Cantidad: Menos de 5

noviembre 2008

Evaluación de Publicaciones

2008 / 2008

Nombre: Brazilian Journal of Probability and Statistics,

Cantidad: Menos de 5

Diciembre 2008

Evaluación de Publicaciones

2008 / 2008

Nombre: Methodology and Computing in Applied Probability,

Cantidad: Menos de 5

Diciembre de 2008

Evaluación de Publicaciones

2007 / 2007

Nombre: Annales de l'Institut Henri Poincaré,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2007 / 2007

Nombre: American Economic Review,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2007 / 2007

Nombre: Electronic Journal of Probability,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2007 / 2007

Nombre: Journal of Mathematical Economics,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2007 / 2007

Nombre: Stochastic Models,

Cantidad: Menos de 5

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Evaluación de Publicaciones

2006 / 2007

Nombre: Annals of Applied Probability,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2006 / 2006

Nombre: Annals of Finance,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2006 / 2008

Nombre: Stochastics and Stochastic Reports,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2005 / 2005

Nombre: Journal of Computational Finance,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2004 / 2004

Nombre: Acta Científica Venezolana,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2004 / 2004

Nombre: Econometrica,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2004 / 2004

Nombre: Journal of Statistical Physics,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2004 / 2004

Nombre: Journal of Theoretical Probability,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2004 / 2006

Nombre: Quantitative Finance,

Cantidad: Menos de 5

december 2008

Evaluación de Publicaciones

2003 / 2007

Nombre: Journal of Applied Probability,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2003 / 2003

Nombre: Journal of Actuarial Practice,

Cantidad: Menos de 5

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Evaluación de Publicaciones

2003 / 2006

Nombre: Stochastics and Processes and their Applications,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

2000 / 2008

Nombre: Mathematical Finance,

Cantidad: De 5 a 20

Octubre de 2008

Evaluación de Publicaciones

1999 / 2007

Nombre: Finance and Stochastics,

Cantidad: De 5 a 20

Evaluación de Publicaciones

1999 / 1999

Nombre: Publicaciones Matematicas del Uruguay,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

1999 / 2011

Nombre: Mathematical Reviews,

Cantidad: Mas de 20

Evaluación de Publicaciones

1993 / 1993

Nombre: Theory of Probability and its Applications,

Cantidad: Menos de 5

Evaluación de Publicaciones

1993 / 1994

Nombre: Referativni Zhurnal,

Cantidad: De 5 a 20

Evaluación de Convocatorias Concursables

2011 / 2011

Nombre: Sistema Nacional de Becas,

Cantidad: Menos de 5

ANII , Uruguay

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Formación de RRHH

Tutorías concluidas

Posgrado

Tesis de doctorado

Modelos asimetricos de Levy en Finanzas. , 2016

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico De Olivera

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Procesos Estocasticos; Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, Pais/Idioma: Uruguay/Español

<http://pedeciba.edu.uy/matematica/>

Tesis de maestría

Opciones Financieras sobre bonos: una aplicación para el mercado uruguayo , 2015

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Guillermo Magnou

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Modelos de renta fija

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel, *País/Idioma:* Uruguay/Español

<https://www.fing.edu.uy/carreras/posgrado/ingenieriamatematica>

Tesis de maestría

Dinámica espacio-temporal de los linajes de DENV-2 genotipo asiático-americano en América , 2014

Tipo de orientación: Asesor/Orientador

Nombre del orientado: Diana Mir

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Bioinformática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Genómica

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Otros Tópicos Biológicos / Bioinformática

Medio de divulgación: Papel, *País/Idioma:* Uruguay/Español

<http://pedeciba.edu.uy/bioinformatica>

Tesis de doctorado

Cambio Climático y su efecto en la biodiversidad , 2013

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Leonardo Ortega

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Ciencias Biológicas (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Estadística

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Conservación de la Biodiversidad

País/Idioma: Uruguay/Español

Tesis de doctorado

Fórmula de Rice: extensiones y aplicaciones , 2013

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico Dalmao

Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Fórmula de Rice

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad Discreta

País/Idioma: Uruguay/Español

Tesis de maestría

Análisis de Valores Extremos para Modelos Espaciales de Lluvias en el Estado de Guanajuato, México. , 2012

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Leonardo Moreno

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Valores extremos

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística

País/Idioma: Uruguay/Español

Tesis de doctorado

Optimal Stopping for Strong Markov Processes: Explicit solutions and verification theorems for diffusions, multidimensional diffusions, and jump-processes. , 2012

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Fabian Croce

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Pais/Idioma: Uruguay/Español

Tesis de maestría

Transformadas Generalizadas de Esscher en la calibracion de modelos para precios de opciones , 2011

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

www.cmat.edu.uy

Sistema Nacional de Investigadores

Tesis de maestría

Valuacion de opciones en mercados de Levy Con Enfoque en Riesgo Cambiario Crediticio en el Uruguay , 2011

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Andres Sosa

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

<http://premat.fing.edu.uy/ingenieriamatematica/>

Tesis de maestría

Calibración del Modelo de Heath-Jarrow-Morton para Mercados de Petróleo , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico de Oliveira

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Matematica Financiera; Procesos Estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Análisis Numérico - Procesos Estocásticos

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

https://sites.google.com/site/ingenieriamatematica/Home/egresados-de-la-maestr%C3%ADa/tesis_federico_deoliveira.pdf?attredirects=0

Sistema Nacional de Investigadores

Tesis de maestría

Estimacion de probabilidades de default en un grupo de bancos mediante copulas , 2010

Nombre del orientado: Gabriel Illanes

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Estadistica

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadistica

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis de maestría

Juegos Competitivos Markovianos , 2009

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Fabián Croce

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Parada óptima

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos de Markov Controlados

Medio de divulgación: Otros, *País/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis de maestría

Flocking Jerárquico con conectividad aleatoria , 2008

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico Dalmao

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Control

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Sistemas Complejos

Medio de divulgación: Otros, *País/Idioma:* Uruguay/Español

[Tesis de maestría](#)

[Opciones rusas para una difusión con saltos , 2000](#)

Tipo de orientación: [Tutor único o principal](#)

Nombre del orientado: [Walter Moreira](#)

[Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Matemática \(UDELAR-PEDECIBA\)](#)

Áreas del conocimiento: [Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Óptima](#)

Medio de divulgación: [Otros](#), *País/Idioma:* [Uruguay/Español](#)

Grado

Tesis/Monografía de grado

Estrategias optimas en juegos estocsticos transitorios , 2010

Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad

Nombre del orientado: Fabian Croce

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Ingeniería en Computación

Palabras clave: Teoria de Juegos

Áreas del conocimiento: Ingeniería y Tecnología / Ingeniería Eléctrica, Ingeniería Electrónica e Ingeniería de la Información / Ingeniería de Sistemas y Comunicaciones / Teoría de Juegos

Medio de divulgación: Papel, *País/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

La formula de Black Scholes , 2008

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Andres Sosa Rodriguez

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Palabras clave: Calculo estocastico; Matematica Financiera

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Medio de divulgación: Papel, *País/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

Modelacion de precios de petroleo mediante series condicionalmente heteroscedasticas , 2008

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Leticia Marziotte

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Estadística

Palabras clave: Series temporales

Áreas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Medio de divulgación: Papel, *País/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

Modelacion de precios de petroleo mediante series condicionalmente heteroscedasticas , 2008

Nombre del orientado: Guillermo Magnou

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Estadística

Palabras clave: Series temporales

Areas del conocimiento: Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

Procesos de Markov controlados: la aplicacion a un juego de dados , 2007

Nombre del orientado: Fabián Crocce

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Palabras clave: Parada óptima

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

El Niño: Predicción del fenómeno (Basado en el análisis estadístico de SST en el atlántico sur) , 2003

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico Olivera

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Estadística

Palabras clave: Climatología

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

Parada óptima en procesos estocásticos , 2003

Nombre del orientado: Federico Dalmao

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

El modelo de Cramér-Lundberg para el problema de la ruina y generalizaciones para colas pesadas , 2001

Nombre del orientado: Eduardo Cuitiño

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Tesis/Monografía de grado

Valuación de opciones europeas y americanas en el modelo binomial. Arbitrajes y ejemplos , 1999

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

[Otras](#)

Iniciación a la investigación

Estadística , 1996

Nombre del orientado: Marcela Ribas

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad y Estadística

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Información adicional: Becaria del Proyecto Conicyt 325/95

Iniciación a la investigación

Matemática , 1996

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad y Estadística

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Información adicional: Becario del Proyecto Conicyt 325/95

Iniciación a la investigación

Matemática , 1996

Nombre del orientado: Isabel Cañette

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad y Estadística

Medio de divulgación: Otros, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

Información adicional: Becario del Proyecto Conicyt 325/95

Otras tutorías/orientaciones

Binomial Models in Finance , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Mok Ngai Ngai

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Otras tutorías/orientaciones

Binomial Models in Finance , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Lam Chung Kong

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Otras tutorías/orientaciones

Binomial Models in Finance , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Sang Tsun Wai Dick

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores

Otras tutorías/orientaciones

Option pricing and implied volatility , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: LI Hang

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Otras tutorías/orientaciones

Option pricing and implied volatility , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: ZHONG Ying

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Otras tutorías/orientaciones

Option pricing and implied volatility , 2010

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: WANG Xiaowen

City University of Hong Kong , Hong Kong

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Hong Kong/Inglés

Tutorías en marcha

Posgrado

Tesis de maestría

A definir , 2015

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Leticia Marziotte

Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay , Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Palabras clave: Estadística

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

<https://www.fing.edu.uy/carreras/posgrado/ingenieriamatematica>

Tesis de doctorado

A definir , 2015

Tipo de orientación: Asesor/Orientador

Nombre del orientado: Gabriel Illanes

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Bioinformatica

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Bioestadística

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

<http://pedeciba.edu.uy/matematica/>

Tesis de doctorado

Modelacion estocastica de la deuda publica uruguaya , 2015

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Andres Sosa

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Matematica Financiera; Procesos Estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

<http://pedeciba.edu.uy/matematica/>

Tesis de doctorado

Modelos probabilísticos en telecomunicaciones. , 2009

Tipo de orientación: Cotutor o Asesor

Nombre del orientado: Laura Aspirot

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Palabras clave: Procesos Estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Telecomunicaciones

Pais/Idioma: Uruguay/Español

Grado

Tesis/Monografía de grado

Modelacion estocastica en musica , 2015

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Veronica Rumbo

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Palabras clave: Modelacion musical

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelacion en musica

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

www.cmat.edu.uy

Tesis/Monografía de grado

Calculo estocastico y simulacion numerica , 2015

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Nicolas Rodriguez

Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay , Licenciatura en Matemática

Palabras clave: Calculo estocastico; Simulacion

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Ecuaciones diferenciales estocasticas

Medio de divulgación: Papel, *Pais/Idioma:* Uruguay/Español

www.cmat.edu.uy

Otros datos relevantes

Premios y títulos

1994 Mejor trabajo del año (Internacional) Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences

1999 Investigador Nacional - Nivel I (Nacional) Fondo Nacional de Investigadores, Ministerio de Educacion y Cultura

2002 Investigador Nacional - Nivel 2 (Nacional) Fondo Nacional de Investigadores, Ministerio de Educacion y Cultura

2007 Investigador del Area Matematica - Primer Nivel (Nacional) PEDECIBA

1998 Investigador del Area Matematica - Segundo Nivel (Nacional) PEDECIBA

2009 Sistema Nacional de Investigadores - Nivel III (Nacional) Agencia Nacional de Investigacion e Innovacion

2015 Miembro de número de la Academia de Ciencias del Uruguay (Nacional) Academia de Ciencias del Uruguay ANCIU

Jurado/Integrante de comisiones evaluadoras de trabajos académicos

Tesis

Candidato: Sebastian Grillo

MORDECKI, E.; SCHAERER, C.; BLANCO BOGADO, G.

OPCIONES REALES EMPLEANDO PROCESOS DE MARKOV DE ESTADO CONTINUO , 2011

Tesis (Maestría en Informática) - Universidad Nacional de Asunción - Paraguay

Referencias adicionales: Paraguay , Español

Palabras clave: Opciones reales

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Tesis

Candidato: Gabriela Camps Rey

MORDECKI, E.

x , 2004

Tesis (Maestría en Ciencias Ambientales) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Estrella Adriana Sicardi

MORDECKI, E.

Sistema Nacional de Investigadores

x , 2003

Tesis (Maestría en Física (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Walter Moreira

MORDECKI, E.

x , 2000

Tesis (Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Juan Kalemkerian

MORDECKI, E.

x , 1998

Tesis (Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Isabel Cañette

MORDECKI, E.

Sistema Nacional de Investigadores

x , 1998

Tesis (Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Graciela Muniz

MORDECKI, E.

x , 1998

Tesis (Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Fernando Pigeard de Almeida Prado

MORDECKI, E.

x , 2004

Tesis (Estatística) - Universidade de São Paulo - Brasil

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Isabel Cañette

MORDECKI, E.

x , 2003

Tesis (Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Nancy Guelman

MORDECKI, E.

x , 2003

Tesis (Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Tesis

Candidato: Carlos Falcón

MORDECKI, E.

x , 2002

Tesis (Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: Lucía Varela

MORDECKI, E.

x , 2004

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: María Valentina Vega

MORDECKI, E.

x , 2004

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: Carlos Frache

MORDECKI, E.

x , 2004

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Economía) - Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: Gabriel Katz

MORDECKI, E.

x , 2004

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Economía) - Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: Mario Luzardo

MORDECKI, E.

x , 2001

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: José Eduardo Díaz

MORDECKI, E.

x , 2001

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Trabajo de conclusión de curso de pregrado

Candidato: Andrea Mesa

MORDECKI, E.

x , 1997

Trabajo de conclusión de curso, (Pregrado) (Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Candidato: Nicolas Frevenza

MORDECKI, E.; GUERBEROFF, G.; KALEMKERIAN, J.

El proceso de contacto , 2011

(Licenciatura en Matemática) - Facultad de Ciencias - UDeLaR - Uruguay

Referencias adicionales: Uruguay , Español

Palabras clave: Sistemas de particulas

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Fisica Matematica

Presentaciones en eventos

Congreso

Rice Formula for processes with jumps and application to the maximum. , 2014

Tipo de participación: Expositor oral, *Carga horaria:* 20

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* International conference on stochastic analysis and related topics; *Nombre de la institución promotora:* Universidad de Campinas

Palabras clave: Fórmula de Rice

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Congreso

Risk neutral prices through impled volatility: smile and smirk. , 2014

Tipo de participación: Expositor oral, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* 2nd Workshop on Probability and Statistical Methods; *Nombre de la institución promotora:* UFSCar, Sao Carlos/SP

Palabras clave: Volatilidad implícita

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Congreso

Rice Formula for processes with jumps and applications , 2013

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* Wshcebor Workshop; *Nombre de la institución promotora:* Universidad de la República

Palabras clave: Fórmula de Rice

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Congreso

A new method with examples in optimal stopping , 2013

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Rusia; *Nombre del evento:* Advanced Finance and Stochastics Conference; *Nombre de la institución promotora:* Steklov Institute

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocasticos

Congreso

Adaptive Weak Approximation of Diffusions with Jumps , 2012

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Uruguay; *Nombre del evento:* Workshop on Stochastic Numerical Methods; *Nombre de la institución promotora:* Facultad de Ingeniería. Udelar

Palabras clave: Metodos numericos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Ecuaciones diferenciales estocasticas

Congreso

Dice: probability, optimal stopping, control and stochastic games , 2010

Tipo de participación: Expositor oral, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Paraguay; *Nombre del evento:* Workshop en Matemática Aplicada y Computacional con Aplicaciones a la Ingeniería: WAMCE; *Nombre de la institución promotora:* Universidad Nacional de Asuncion

Palabras clave: Juegos estocasticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Control estocastico

Congreso

Simmety duality and skewness in Levy markets , 2009

Tipo de participación: Conferencista Invitado,

Referencias adicionales: Venezuela; *Nombre del evento:* Xi Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática; *Nombre de la institución promotora:* Sociedad Latinoamericana de Probabilidad y Estadística Matemática

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Congreso

Is a Brownian motion Skew? , 2009

Tipo de participación: Conferencista Invitado,

Referencias adicionales: Venezuela; *Nombre del evento:* XI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática; *Nombre de la institución promotora:* Sociedad Latinoamericana de Probabilidad y Estadística Matemática

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de procesos aleatorios

Congreso

Adaptive weak approximation of diffusion with jumps , 2008

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Hong Kong; *Nombre del evento:* Foundations of Computational Mathematics 2008; *Nombre de la institución promotora:* City University of Hong Kong

Palabras clave: Metodos numericos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Computación e Información / Ciencias de la Computación / Análisis numerico en ecuaciones diferenciales estocasticas

Congreso

XXX Congresso Nacional de Matemática Aplicada e Computacional , 2007

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* XXX Congresso Nacional de Matemática Aplicada e Computacional; *Nombre de la institución promotora:* Sociedad de Matemática Aplicada y Computacional

"Optimal Stopping of Hunt and Lévy Processes". XXX Congresso Nacional de Matemática Aplicada e Computacional, Conferencia en el Minisimposio: "Modelagem matemática em finanças", 3 al 6 de setiembre de 2007, Florianópolis, Brasil

Congreso

Conference on Stochastics in Science. In Honor of Ole E.Barndorff-Nielsen , 2006

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: México; *Nombre del evento:* Conference on Stochastics in Science. In Honor of Ole E.Barndorff-Nielsen; *Nombre de la institución promotora:* Centro de Investigaciones Matemáticas

Titulo: "Ruin Probability and Optimal Stopping for Levy Processes" , March 20-24, 2006, Guanajuato, Mexico.

Congreso

Mathematics and Finance: from Theory to Practice , 2006

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* Mathematics and Finance: from Theory to Practice; *Nombre de la institución promotora:* IMPA

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Modelos estocasticos en Finanzas

Titulo de la conferencia: Duality and Symmetry in Levy Markets

Congreso

Segundo Congreso Latinoamericano de Matematicos (UMALCA), , 2004

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: México; *Nombre del evento:* Segundo Congreso Latinoamericano de Matematicos,; *Nombre de la institución promotora:* Union Matematica de America Latina y el Caribe
20 al 26 de Junio de 2004. Conferencia en la sesion de Probabilidad y Estadística. Título: Find the Martingale, Cancun, Mexico.

Congreso

IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática , 2004

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Uruguay; *Nombre del evento:* IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática; *Nombre de la institución promotora:* Regional Latinoamericana de la Sociedad Bernoulli
22 al 26 de marzo de 2004, Punta del Este, Uruguay. Conferencia en la sesion especial: Procesos de Levy. Título: "Exact distribution of the maximum of a Levy process"

Congreso

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA , 2003

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Chile; *Nombre del evento:* XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA; *Nombre de la institución promotora:* Universidad Católica del Norte

Antofagasta Chile, 5 al 9 de agosto de 2003. Conferencia: Dualidad put-call y simetría para procesos de Levy

Congreso

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA , 2003

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 4

Referencias adicionales: Chile; *Nombre del evento:* XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA; *Nombre de la institución promotora:* Universidad Católica del Norte

Antofagasta Chile, 5 al 9 de agosto de 2003. Conferencia: Comparación de experimentos estadísticos generados por procesos de Levy

Congreso

Conference dedicated to the 90th anniversary of B. V. Gnedenko , 2002

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Ucrania; *Nombre del evento:* Conference dedicated to the 90th anniversary of B. V. Gnedenko; *Nombre de la institución promotora:* National Taras Shevchenko University of Kiev

Título: Optimal Stopping and Ruin probabilities for Levy processes. June 3-7, 2002, Kiev.

Seminario

Optimal stopping for polynomial rewards , 2015

Tipo de participación: Expositor oral, *Carga horaria:* 8

Referencias adicionales: Finlandia; *Nombre del evento:* Seminar in Optimal Stopping; *Nombre de la institución promotora:* Abo Akademi

Palabras clave: Parada óptima

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Óptima

Seminario

Parada óptima de procesos estocásticos , 2012

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Venezuela; *Nombre del evento:* Aniversario de la Facultad de Ciencias de la Universidad Central de Venezuela; *Nombre de la institución promotora:* Universidad Central de Venezuela

Áreas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Seminario

Seminarie Bachelier , 2005

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Francia; *Nombre del evento:* Seminarie Bachelier; *Nombre de la institución promotora:* Instituto Henri Poincare

"Ruin probabilities for Lévy processes: exact solutions", Paris, 4/9/2005

Seminario

Seminar on Stochastic Differential Equations , 2005

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Finlandia; *Nombre del evento:* Seminar on Stochastic Differential Equations; *Nombre de la institución promotora:* Universidad de Jyväskylä

Perpetual American options for Lévy processes. 28/04/2005

Seminario

Conference at the Finnish Mathematical Society , 2005

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Finlandia; *Nombre del evento:* Conference at the Finnish Mathematical Society; *Nombre de la institución promotora:* University of Helsinki

Título: Exact Ruin Probabilities for a class of Levy processes. Monday 11 April 2005.

Seminario

Seminario del Instituto de Matematica Aplicada del Litoral (IMAL) , 2004

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Argentina; *Nombre del evento:* Seminario del Instituto de Matematica Aplicada del Litoral (IMAL); *Nombre de la institución promotora:* CONICET Universidad Nacional del Litoral

Título: Problemas de barrera en procesos estocásticos. Santa Fe, Argentina (24/9/2004)

Seminario

Seminario de Probabilidad IME Universidad de San Pablo , 2004

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* Seminario de Probabilidad IME Universidad de San Pablo; *Nombre de la institución promotora:* Instituto de Matematica y Estadística. Universidad de San Pablo

Título: Duality and Derivative Pricing with Levy Processes. 29 de enero de 2004

Seminario

Seminario Laboratoire de Statistique et Probabilites , 2000

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Francia; *Nombre del evento:* Seminario Laboratoire de Statistique et Probabilites; *Nombre de la institución promotora:* Universidad Paul Sabatier

Arret optimal et options perpetuelles pour les processus de Levy, 6/2000. Toulouse.

Simposio

Symposium on Optimal Stopping with Applications , 2006

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Gran Bretaña; *Nombre del evento:* Symposium on Optimal Stopping with Applications; *Nombre de la institución promotora:* University of Manchester

Título: "Optimal Stopping and maxima for Levy Processes", 22-27 January 2006.

Taller

Workshop on mathematical Finance , 2008

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Japón; *Nombre del evento:* Workshop on mathematical finance; *Nombre de la institución promotora:* Center for finance and insurance. Osaka University.

Taller

Workshop on Stochastic Modelling , 2008

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Brasil; *Nombre del evento:* Workshop on Stochastic Modelling; *Nombre de la institución promotora:* Universidad de San Pablo

Se realizó en el campus de Riberao Preto

Taller

Winter School of the Finnish Visitors Program , 2005

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Finlandia; *Nombre del evento:* Winter School of the Visitors Program; *Nombre de la institución promotora:* Finnish Minister of Education

Título: Optimal Stopping and Ruin probabilities for Levy processes. Mekrijarvi Research Station, 14-16.3.2005.

Encuentro

Cuarto Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matematica , 2007

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Argentina; *Nombre del evento:* Cuarto Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matematica; *Nombre de la institución promotora:* Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matematica

Palabras clave: Procesos Estocásticos

Areas del conocimiento: Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Título de la Conferencia: On the maximum of a Levy Processes: Explicit Solutions

Encuentro

Tercer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática , 2006

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Argentina; *Nombre del evento:* Tercer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática; *Nombre de la institución promotora:* Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Título de la Conferencia: Symmetry and Duality in Levy Markets

Encuentro

Primer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática , 2004

Tipo de participación: Conferencista Invitado, *Carga horaria:* 40

Referencias adicionales: Argentina; *Nombre del evento:* Primer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática; *Nombre de la institución promotora:* Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Título: Modelos Estocásticos en Finanzas. Conferencia inicial de la sesión 'Ecuaciones estocásticas y aplicaciones en finanzas' Buenos Aires, Argentina, 30/09/2004 al 02/10/2004.

Indicadores de producción

<i>Producción bibliográfica</i>	63
<i>Artículos publicados en revistas científicas</i>	34
Completo (Arbitrada)	34
<i>Artículos aceptados para publicación en revistas científicas</i>	3
Completo (Arbitrada)	3
<i>Trabajos en eventos</i>	21
Completo (Arbitrada)	4
Completo (No Arbitrada)	1
Resumen (Arbitrada)	13
Resumen (No Arbitrada)	3
<i>Libros y capítulos de libros publicados</i>	4
Libro publicado	3
Libro compilado	1
<i>Textos en periódicos</i>	1
Periodicos	1
<i>Documentos de trabajo</i>	0
<i>Producción técnica</i>	65
<i>Productos tecnológicos</i>	0
<i>Procesos o técnicas</i>	0
<i>Trabajos técnicos</i>	13
<i>Otros tipos</i>	24
<i>Evaluaciones</i>	35
Evaluación de Proyectos	5
Evaluación de Publicaciones	29
Evaluación de Convocatorias Concursables	1
<i>Formación de RRHH</i>	38
<i>Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas</i>	32
Tesis de maestría	10
Tesis de doctorado	4
Tesis/Monografía de grado	9
Iniciación a la investigación	3
Otras tutorías/orientaciones	6
<i>Tutorías/Orientaciones/Supervisiones en marcha</i>	6
Tesis de maestría	1
Tesis de doctorado	3
Tesis/Monografía de grado	2

Sistema Nacional de Investigadores

Sistema Nacional de Investigadores