



ANDRÉS RICARDO SOSA  
RODRÍGUEZ

Dr.

[asosa@cmat.edu.uy](mailto:asosa@cmat.edu.uy)  
11400  
2525-2522

SNI

Ciencias Sociales / Economía y Negocios

Categorización actual: Iniciación (Activo)

Fecha de publicación: 27/12/2018  
Última actualización SNI: 27/12/2018

## Datos Generales

### INSTITUCIÓN PRINCIPAL

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

### DIRECCIÓN INSTITUCIONAL

Institución: Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Sector Educación Superior/Público

/ Centro de Matemática

Dirección: Iguá 4225 - Piso 15 - Oficina 11 / 11400 / Montevideo , Montevideo , Uruguay

Teléfono: (5982) 5258617 / 121

Correo electrónico/Sitio Web: [asosa043@gmail.com](mailto:asosa043@gmail.com) <http://www.cmat.edu.uy/>

## Formación

### Formación académica

#### CONCLUIDA

#### DOCTORADO

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

Universidad de la República - Facultad de Ciencias - UDeLaR, Centro de Matemática , Uruguay  
Título de la disertación/tesis: Modelos estocásticos en tasas de interés y aplicaciones en la deuda soberana en Uruguay

Tutor/es: Ernesto Mordecki

Obtención del título: 2018

Sitio web de la disertación/tesis: <http://www.cmat.edu.uy/cmat/biblioteca/documentos/tesis/tesis-de-doctorado>

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

Áreas de conocimiento:

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

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

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

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

#### MAESTRÍA

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

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

Título de la disertación/tesis: Valuación de opciones en mercados de Lévy con Enfoque en Riesgo Cambiario Crediticio en el Uruguay

Tutor/es: Ernesto Mordecki Pupko

Obtención del título: 2011

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

Financiación:

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

Palabras Clave: Riesgo Cambiario Crediticio

Áreas de conocimiento:

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

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

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

#### ESPECIALIZACIÓN/PERFECCIONAMIENTO

### **Certificado en Econometría (2014 - 2015)**

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Sociales - UDeLaR, Departamento de Economía, Uruguay

Título de la disertación/tesis: -

Obtención del título: 2015

Áreas de conocimiento:

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

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

### **Diploma en Economía y Gestión Bancaria (2010 - 2010)**

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Sociales - UDeLaR, Departamento de Economía, Uruguay

Título de la disertación/tesis: --

Obtención del título: 2010

Palabras Clave: Sistema Bancario Riesgo Macroeconomía Microeconomía

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Gestión Bancaria

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Negocios y Administración / Análisis de Riesgos

### **GRADO**

#### **Licenciatura en Matemática (2004 - 2008)**

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

Título de la disertación/tesis: Modelo de Black-Scholes

Tutor/es: Ernesto Mordecki

Obtención del título: 2009

Palabras Clave: Black-Scholes

Áreas de conocimiento:

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

Finanzas

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

## **Idiomas**

### **Inglés**

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

## **Áreas de actuación**

### **CIENCIAS NATURALES Y EXACTAS**

Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelos matemáticos en Finanzas

### **CIENCIAS NATURALES Y EXACTAS**

Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

### **CIENCIAS SOCIALES**

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

### **CIENCIAS SOCIALES**

Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía Bancaria

## **Actuación profesional**

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

Facultad de Ciencias - UDeLaR / Centro de Matemática

### **VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN**

Otro (04/2017 - a la fecha)

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

**Otro (07/2012 - 04/2017)**

Asistente Grado 2 Centro de Matemática ,30 horas semanales  
Escalafón: Docente  
Grado: Grado 2  
Cargo: Interino

**Otro (05/2009 - 07/2012)**

Ayudante Grado 1 Centro de Matemática ,20 horas semanales  
Escalafón: Docente  
Grado: Grado 1  
Cargo: Interino

**ACTIVIDADES**

**LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN**

**Métodos Estocásticos en Finanzas (01/2009 - a la fecha )**

Formo parte de un grupo de estudio en aplicación de procesos estocásticos en finanzas.  
Mixta  
2 horas semanales  
Facultad de Ciencias, Centro de Matemática , Integrante del equipo  
Equipo: Andrés Ricardo SOSA RODRÍGUEZ , Ernesto MORDECKI PUPKO , Federico De Olivera Lamas , MAGNOU, G.  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

**Mellizos y Gemelos en el Uruguay (01/2017 - a la fecha )**

Colaboro en la confección estadística de los modelos a utilizar y en la manipulación de datos. Fui contactado por la estudiante de la Licenciatura Noelia Gómez, con el fin de participar en el proyecto. Los resultados obtenidos fueron expuestos en el II Encontro de Gemeos na USP, en San Pablo - Brasil.  
Aplicada  
2 horas semanales  
Facultad de Ciencias , Integrante del equipo  
Equipo: NOELIA GOMEZ , SILVIA CORTE , MONICA SANS  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Biología Reproductiva /

**Model: Zero Black Derman Toy (12/2016 - a la fecha )**

Aplicada  
5 horas semanales  
Facultad de Ciencias, Centro de Matemática , Integrante del equipo  
Equipo: MORDECKI, ERNESTO , KRZYŻANOWSKI, GRZEGORZ  
Palabras clave: Modelación de Tasa de Interés  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

**DOCENCIA**

**Licenciatura Bioquímica/Ciencias Biológicas (08/2017 - 12/2017 )**

Grado  
Asistente  
Asignaturas:  
Bioestadística, 94 horas, Práctico  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

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

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática 1, 94 horas, Teórico-Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

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

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y Estadística, 6 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

**(03/2016 - 08/2016 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Bioestadística, 6 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

**(03/2016 - 08/2016 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I, 6 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura /

**(11/2015 - 11/2015 )**

Grado

Invitado

Asignaturas:

Cadena de Markov, 4 horas, Teórico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

**(03/2015 - 08/2015 )**

Grado

Organizador/Coordinador

Asignaturas:

Matemática I, 10 horas, Teórico-Práctico

**(08/2014 - 12/2014 )**

Grado

Organizador/Coordinador

Asignaturas:

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

**(03/2014 - 08/2014 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y estadística, 6 horas, Práctico

**(08/2013 - 12/2013 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

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

**(08/2013 - 12/2013 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

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

Áreas de conocimiento:

Ingeniería y Tecnología / Otras Ingenierías y Tecnologías / Otras Ingenierías y Tecnologías /

**(03/2013 - 07/2013 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Introducción a la Probabilidad y estadística, 6 horas, Práctico

**(08/2012 - 12/2012 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

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

**(08/2011 - 12/2011 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I Segundo Semestre, 8 horas, Práctico

**(03/2011 - 07/2011 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática I, 6 horas, Práctico

**(08/2010 - 12/2010 )**

Grado

Asistente

Asignaturas:

Matemática II, 6 horas, Práctico

**EXTENSIÓN**

**Proyecto Imaginary (01/2015 - a la fecha )**

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

2 horas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Divulgación Matemática

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

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

2 horas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Divulgación

**Latitud Ciencias (03/2013 - 07/2013 )**

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

3 horas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Difusión

**PASANTÍAS**

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

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

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

Universidad Autónoma de Madrid, Quantitative Risk Research  
40 horas semanales

Áreas de conocimiento:

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

**GESTIÓN ACADÉMICA**

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

Facultad de Ciencias Participación en consejos y comisiones , 2 horas semanales

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

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

**SECTOR EMPRESAS/PRIVADO - EMPRESA PRIVADA - URUGUAY**

Banco Itaú

**VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN**

**Funcionario/Empleado (12/2011 - 09/2012)**

Analista de Crédito Wholesale ,40 horas semanales

**CARGA HORARIA**

Carga horaria de docencia: 8 horas  
Carga horaria de investigación: 20 horas  
Carga horaria de formación RRHH: Sin horas  
Carga horaria de extensión: 2 horas  
Carga horaria de gestión: 10 horas

**Producción científica/tecnológica**

Mi tema de investigación se centra en el estudio de la matemática financiera.

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

Los bancos comerciales, los fondos de inversión, las compañías de seguros y las agencias reguladoras aplican sus conocimientos en la valuación de activos y derivados financieros, la estructura de portafolio, la gestión de riesgos y la simulación de posibles escenarios .

En la actualidad la investigación abarca diferentes temáticas, particularmente las relacionadas con la valuación de los activos financieros que se encuentran sujetos a incertidumbre.

Mis principales contribuciones las realicé en el área de valuación de derivados financieros, más precisamente, en el área de la valuación del derivado financiero denominado opciones. Esta fijación de precios la realizamos mediante ciertos métodos que dependen de los datos disponibles en el mercado. Este desarrollo permite calcular precios de opciones teóricos en países, como Uruguay, que no tiene un mercado muy desarrollado.

En el presente, mi área de actuación principal se centra en el estudio de modelos estocásticos en tasas de interés. Se modela la oferta de bonos soberanos y se estiman curvas de rendimientos.

La motivación que encuentro para investigar en estos temas de matemática y finanzas es encontrar acercamiento entre la investigación y las prácticas habituales de los agentes participantes del

mercado, al reducir la distancia entre los dos ámbitos en Uruguay.

## Producción bibliográfica

### ARTÍCULOS PUBLICADOS

#### ARBITRADOS

##### **Pricing Bond Options in Emerging Markets: a case study (Completo, 2018)**

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

Journal of Dynamics and Games, v.: 5 1 , p.:21 - 30, 2018

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

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: American Institute of Mathematical Sciences

ISSN: 21646066

DOI: [10.3934/jdg.2018003](https://doi.org/10.3934/jdg.2018003)

<http://aims sciences.org/journal/2164-6066>

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

SOSA ANDRES

Perspectivas, revista de análisis de economía, comercio y negocios internacionales, v.: 12 1 , p.:31 - 46, 2018

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 20072104

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

 latindex

##### **A Macroeconomics Model Of Credit Risk In Uruguay (Completo, 2016)**

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

Revista Brasileira de Economia, v.: 70 4, p.:441 - 455, 2016

Palabras clave: Macroeconomics Credit Risk

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Rio de Janeiro

ISSN: 00347140

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

Scopus® WEB OF SCIENCE®  latindex  SciELO

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

SOSA ANDRES

Compendium: Reports on Economics and Management, v.: 2 4 , p.:47 - 68, 2015

Palabras clave: Series Temporales Análisis Espectral Mercado Laboral

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Guayaquil, Ecuador

Escrito por invitación

ISSN: 13908391

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

##### **Caracterización y Estimación del riesgo cambiario crediticio en economías parcialmente dolarizadas**

**(Completo, 2013)**

SOSA ANDRES, PENA, A.  
Revista de Economía, v.: XX 2, p.:61 - 91, 2013  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economías altamente dolarizadas  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera  
Medio de divulgación: Papel  
ISSN: 07975546  
<http://www.bcu.gub.uy>

[latindex](#)

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

SOSA ANDRES, PENA, A.  
Risk Governance & Control: Financial Markets & Institutions, v.: 3 2 2013, p.:58 - 73, 2013  
Palabras clave: Risk Management  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /  
Medio de divulgación: Papel  
ISSN: 20774303  
[http://www.virtusinterpress.org/IMG/pdf/RGC\\_\\_Volume\\_3\\_Issue\\_2\\_2013\\_contents.pdf](http://www.virtusinterpress.org/IMG/pdf/RGC__Volume_3_Issue_2_2013_contents.pdf)

**ARTÍCULOS ACEPTADOS**

**ARBITRADOS**

**Twinning rates in Uruguay between 1999 and 2015: association with socioeconomic and demographic factors (Completo, 2018)**

SOSA ANDRES, GOMEZ NOELIA, CORTE, S., OTTA, EMA

Twin Research and Human Genetics, 2018  
Palabras clave: Twinning rates; Hellin Ratio; socioeconomic variables demographic factors assisted reproduction techniques  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Geografía Económica y Social / Geografía Económica y Social /  
Medio de divulgación: Papel  
Lugar de publicación: Cambridge University Press  
Fecha de aceptación: 21/11/2018  
ISSN: 18324274

**LIBROS**

**Trends in Mathematical Economics (Libro publicado Otra, 2016)**

SOSA ANDRES, MORDECKI, E.  
Edición: ,  
Editorial: Springer International Publishing Switzerland, Estados Unidos  
Tipo de publicación: Investigación  
DOI: [10.1007/978-3-319-32543-9\\_17](https://doi.org/10.1007/978-3-319-32543-9_17)  
Referado  
Escrito por invitación  
Palabras clave: Gaussians Models  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelación en Tasas de Interés  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /  
Medio de divulgación: Papel  
ISSN/ISBN: 9783319325439  
<http://www.springer.com/gp/book/9783319325415>

**Enseñar Investigando (Libro publicado Otra, 2015)**

SOSA ANDRES, BERGÓS, HUGO COITIÑO, CECILIA SILVARREY



Número de volúmenes: 1  
Edición: ,  
Editorial: DIRAC, Montevideo  
Tipo de publicación: Investigación  
Escrito por invitación  
Áreas de conocimiento:  
Humanidades / Otras Humanidades / Otras Humanidades / Metodología de enseñanza en relación a la investigación  
Medio de divulgación: Papel  
ISSN/ISBN: 9789974012738

## DOCUMENTOS DE TRABAJO

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

Completo  
SOSA ANDRES, MORDECKI, ERNESTO  
Serie: 1,  
Palabras clave: Simulación  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /  
Medio de divulgación: Internet  
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/probabilidad-eliminarias.pdf>

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

Completo  
SOSA ANDRES, ILLANES, PENA, ALEJANDRO  
Serie: -,  
<http://www.bcu.gub.uy>  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Modelos De Riesgo de Crédito  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Macroeconomía  
Medio de divulgación: Internet  
<http://www.bcu.gub.uy>

## PUBLICACIÓN DE TRABAJOS PRESENTADOS EN EVENTOS

### **Disaster Risk Reduction (2017)**

Completo  
SOSA ANDRES, Santos Leonardo, Londe Luciana, Aguilar Viviana, Obregón Guillermo  
  
Evento: Internacional  
Descripción: International Workshop on Mathematics of. Climate Change and Natural Disasters  
Ciudad: São José dos Campos  
Año del evento: 2017  
Anales/Proceedings: Final Report: Mathematics Threat Hazard  
Página inicial: 35  
Página final: 45  
Medio de divulgación: Internet  
Financiación/Cooperación:  
Agencia Nacional de Investigación e Innovación / Apoyo financiero, Uruguay  
<http://www.lac.inpe.br/cciam/>

## TEXTOS EN PERIÓDICOS O REVISTAS

### **¿Cuánto dura la ola celeste? (2016)**

Lento v: 45, 17, 21  
Revista  
SOSA ANDRES, MORDECKI, ERNESTO  
  
Palabras clave: Difusión  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /  
Medio de divulgación: Papel

Fecha de publicación: 01/12/2016  
Lugar de publicación: Montevideo

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

Búsqueda  
Revista  
SOSA ANDRES

Palabras clave: Desocupación. Morosidad.

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Fecha de publicación: 12/06/2014

Lugar de publicación: Montevideo

<http://www.búsqueda.com.uy/>

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

## **Evaluaciones**

### **EVALUACIÓN DE PUBLICACIONES**

#### **REVISIONES**

##### **Revista Sociedad y Economía ( 2018 / 2018 )**

Tipo de publicación: Revista  
Cantidad: Menos de 5

##### **Brazilian Journal of Probability and Statistics ( 2015 / 2016 )**

Tipo de publicación: Revista  
Cantidad: Menos de 5

## **Otros datos relevantes**

### **PRESENTACIONES EN EVENTOS**

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

Congreso

Yield Curve Modelling in emerging markets: Uruguay case study

Uruguay

Tipo de participación: Poster

Carga horaria: 30

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

Palabras Clave: Big Data

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

#### **IV Jornadas de Estadística Aplicada (2017)**

Encuentro

Las bondades del filtro de Kalman

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

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

Palabras Clave: Kalman Filter

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

#### **III Jornadas Argentinas de Econometría (2016)**

Seminario  
Análisis Espectral del Mercado Laboral en Uruguay  
Argentina  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 16  
Palabras Clave: Análisis Espectral  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

#### **Coloquio de Estudiantes de Matemática (2016)**

Seminario  
Probabilidad y Estadística Aplicada al Deporte  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 2  
Palabras Clave: Simulación  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

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

Congreso  
Modeling the Uruguayan Sovereign Debt  
Colombia  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 40  
Palabras Clave: Quantitative Finance  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

#### **Imaginary Congress 2016 (2016)**

Congreso  
Mathematical education TV program  
Alemania  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 40  
Palabras Clave: Difusión de las Ciencias  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Difusión

#### **III Jornadas de Estadística Aplicada (2015)**

Seminario  
Tasas de interés y volatilidad implícita  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 16  
Palabras Clave: Interest Rate  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

#### **Grupo de Estudio de Educación Matemática (2015)**

Taller  
Introducción al libro: Mathematical problem solving -- Alan Schoenfeld  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 2  
Nombre de la institución promotora: Centro de Matemática  
Palabras Clave: Educación Matemática  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura  
Ciencias Sociales / Psicología / Psicología especial

#### **Seminario de Probabilidad y Estadística (2015)**

Seminario  
Modelación en Tasas de Interés  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 2  
Nombre de la institución promotora: Centro de Matemática  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada

#### **Research in Options (2014)**

Congreso  
Dynamic modeling of interest rate for the Uruguayan debt  
Brasil  
Tipo de participación: Poster  
Carga horaria: 5  
Nombre de la institución promotora: Instituto de Matemática Pura y Aplicada  
Palabras Clave: Dynamic Modeling, Interest Rate.  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Deuda Soberana

#### **II Jornadas de Estadística Aplicada (2014)**

Seminario  
Tasas de interés y volatilidad implícita.  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Carga horaria: 5  
Nombre de la institución promotora: Laboratorio de Probabilidad y Estadística de la Facultad de Ingeniería -- Polo de Desarrollo Universitario Modelización y Análisis de Recursos Naturales  
Palabras Clave: Tasas de interés. Volatilidad Implícita  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Cálculo Estocástico  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Tasa de Interés

#### **XXVIII Jornadas Anuales de Economía (2013)**

Congreso  
Modelo Macroeconómico del Riesgo de Crédito en Uruguay  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay  
Palabras Clave: Modelo de Crédito de un factor  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelo de Riesgo de Crédito

#### **XXVII Jornadas Anuales de Economía (2012)**

Congreso  
Riesgo Cambiario Crediticio: Medidas e Implicaciones  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay  
Palabras Clave: Riesgo Cambiario Crediticio  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Riesgo de Mercado

#### **Seminario de Gestión Bancaria (2012)**

Seminario  
Mercados de Derivados: Métodos de Valuación de Instrumentos Financieros  
Uruguay  
Tipo de participación: Expositor oral  
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Sociales  
Palabras Clave: Mercado de Derivados  
Areas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Derivados Financieros

### **Seminario de Finanzas (2011)**

Seminario  
Valuación de opciones en Mercados Incompletos  
España  
Tipo de participación: Expositor oral  
Nombre de la institución promotora: Universidad Autónoma de Madrid  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

### **Research in Options (2010)**

Congreso  
Valuación de opciones en Mercados Incompletos  
Brasil  
Tipo de participación: Otros  
Nombre de la institución promotora: Instituto Nacional de Matemática Pura y Aplicada  
Palabras Clave: Valuación de Opciones  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Mercado Financieros

### **Jornadas de Ingeniería Matemática (2010)**

Otra  
Transformada de Fourier aplicada a Mercados Incompletos  
Uruguay  
Tipo de participación: Poster  
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ingeniería  
Palabras Clave: Transformada de Fourier  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera

## **JURADO/INTEGRANTE DE COMISIONES EVALUADORAS DE TRABAJOS ACADÉMICOS**

### **Parada óptima en procesos de Markov de tiempo discreto y aplicaciones (2017)**

Candidato: Facundo Oliú  
Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado  
SOSA ANDRES, J.R. León  
Licenciatura en Matemática / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Uruguay  
País: Uruguay  
Idioma: Español

### **Opciones Financieras sobre Bonos - Una aplicación para el Mercado Uruguayo (2015)**

Candidato: Guillermo Magnou  
Tipo Jurado: Tesis de Maestría  
PENA, ALEJANDRO, ENRIQUE CABAÑA, SOSA ANDRES  
Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática) / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería - UDeLaR / Uruguay  
País: Uruguay  
Idioma: Español  
Palabras Clave: Opciones financieras. Bonos soberanos  
Áreas de conocimiento:  
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Derivados Financieros

## **Información adicional**

### **Indicadores de producción**

<b>PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA</b>	<b>14</b>
<b>Artículos publicados en revistas científicas</b>	<b>6</b>

Completo	6
<b>Artículos aceptados para publicación en revistas científicas</b>	1
Completo	1
<b>Trabajos en eventos</b>	1
<b>Libros y Capítulos</b>	2
Libro publicado	2
<b>Textos en periódicos</b>	2
Revistas	2
<b>Documentos de trabajo</b>	2
Completo	2
<b>EVALUACIONES</b>	<b>2</b>
<b>Evaluación de publicaciones</b>	2