



ANDRÉS RICARDO SOSA
RODRÍGUEZ

Dr.

asosa@cmat.edu.uy
11400
2525-2522

SNI

Ciencias Sociales / Economía y Negocios
Categorización actual: Inicia ción (Activo)

Fecha de publicación: 12/11/2018
Última actualización SNI: 12/11/2018

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 <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

Cambiarío 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 Cambiarío 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
Escala: 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 Encuentro 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 Bioqímica/Ciencias Biológicas (08/2017 - 12/2017)

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

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

Grado
Asistente
Asignaturas:
Matemática 1, 94 horas, Teórico-Práctico
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

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

Grado
Asistente
Asignaturas:
Introducción a la Probabilidad y Estadística, 6 horas, Práctico
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2016 - 08/2016)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Bioestadística, 6 horas, Práctico
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2016 - 08/2016)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Matemática I, 6 horas, Práctico
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura /

(11/2015 - 11/2015)

Grado
Invitado
Asignaturas:
Cadena de Markov, 4 horas, Teórico
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

(03/2015 - 08/2015)

Grado
Organizador/Coordinador
Asignaturas:
Matemática I, 10 horas, Teórico-Práctico

(08/2014 - 12/2014)

Grado
Organizador/Coordinador
Asignaturas:
Bioestadística / Tratamiento de Datos y Diseño, 6 horas, Práctico

(03/2014 - 08/2014)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Introducción a la Probabilidad y estadística, 6 horas, Práctico

(08/2013 - 12/2013)

Grado
Asistente
Asignaturas:

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

(08/2013 - 12/2013)

Grado

Asistente

Asignaturas:

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

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. Esta disciplina es la aplicación de métodos matemáticos a la solución de problemas financieros. Se basa en herramientas de matemática aplicada, informática, estadística y teoría económica. Los bancos comerciales, bancos de inversión, las compañías de seguros y las agencias reguladoras aplican estos métodos a los problemas financieros como lo son la valuación de derivados, la estructura de portafolios, la gestión de riesgos y la simulación de escenarios posibles.

La matemática se torna de gran importancia ya que permite modelar las relaciones entre ciertas variables fundamentales (precios de activos, tasas de interés, entre otras) y representar su aleatoriedad de manera que conduzcan a un análisis de interés. En los últimos años, con el progreso de los computadores y la complejidad de los datos financieros se ha transformado en un tema de mucho interés en la comunidad científica.

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 la actualidad, mi área de actuación se centra principalmente en el estudio de modelos estocásticos en tasas de interés. Se modela la oferta de bonos en general y se estiman curvas de rendimientos. Estos modelos los aplique al caso de Uruguay en las tres principales monedas de emisión.

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
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economías altamente

dolarizadas
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matemática Financiera
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 07975546
<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
Areas 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

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
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelación en Tasas de Interés
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /
Medio de divulgación: Papel
ISSN/ISBN: 9783319325439
<http://www.springer.com/gp/book/9783319325415>

Enseñar Investigando (Libro publicado Otra , 2015)

SOSA ANDRES , BERGÓ S, HUGO COITIÑO , CECILIA SILVARREY
Número de volúmenes: 1
Edición: ,
Editorial: DIRAC, Montevideo
Tipo de publicación: Investigación
Escrito por invitación
Areas de conocimiento:
Humanidades / Otras Humanidades / Otras Humanidades / Metodología de enseñanza en relación a la investigación
Medio de divulgación: Papel
ISSN/ISBN: 9789974012738

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
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /
Medio de divulgación: Internet
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/probabilidad-eliminotorias.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.
Áreas 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
Areas 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
Areas 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

Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Imaginary Congress 2016 (2016)

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

III Jornadas de Estadística Aplicada (2015)

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

Grupo de Estudio de Educación Matemática (2015)

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

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

Áreas 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

Áreas 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

Áreas 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

Áreas 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

PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA	13
Artículos publicados en revistas científicas	6
Completo	6
Trabajos en eventos	1
Libros y Capítulos	2
Libro publicado	2
Textos en periódicos	2
Revistas	2
Documentos de trabajo	2
Completo	2
EVALUACIONES	2
Evaluación de publicaciones	2