



ANDRÉS RICARDO SOSA
RODRÍGUEZ

Dr.

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

SNI

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

Fecha de publicación: 18/09/2025
Última actualización: 16/09/2025

Datos Generales

INSTITUCIÓN PRINCIPAL

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

DIRECCIÓN INSTITUCIONAL

Institución: Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Sector Educación Superior/Público / Departamento de Métodos Cuantitativos
Dirección: Gonzalo Ramírez 1926 / 11200
País: Uruguay / Montevideo / Montevideo
Teléfono: (+598) 24118839
Correo electrónico/Sitio Web: andres.sosa@fcea.edu.uy <http://www.iesta.edu.uy>

Formación

Formación académica

CONCLUIDA

DOCTORADO

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

Universidad de la República - Facultad de Ciencias, Centro de Matemática, Uruguay
Título de la disertación/tesis/defensa: Modelos estocásticos en tasas de interés y aplicaciones en la deuda soberana en Uruguay
Tutor/es: Ernesto Mordecki
Obtención del título: 2018
Sitio web de la disertación/tesis/defensa: <http://www.cmat.edu.uy/cmat/biblioteca/documentos/tesis/tesis-de-doctorado>
Financiación:

Universidad de la República / Comisión Académica de Posgrado, Uruguay
Palabras Clave: Interest Rate Model Term Structure Kalman Filter Default Risk Country Risk Index
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, Uruguay
Título de la disertación/tesis/defensa: Valuación de opciones en mercados de Lévy con Enfoque en Riesgo Cambiario Crediticio en el Uruguay
Tutor/es: Ernesto Mordecki Pupko
Obtención del título: 2011
Sitio web de la disertación/tesis/defensa: <http://premat.fing.edu.uy/IngenieriaMatematica/>
Financiación:
Agencia Nacional de Investigación e Innovación / Agencia Nacional de Investigación e Innovación, Uruguay
Palabras Clave: Riesgo Cambiario Crediticio
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, Departamento de Economía , Uruguay

Título de la disertación/tesis/defensa: -

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, Departamento de Economía , Uruguay

Título de la disertación/tesis/defensa: --

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 , Uruguay

Título de la disertación/tesis/defensa: 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 Económicas y de Administración /
Departamento de Métodos Cuantitativos

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

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

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

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Wright Fischer Model (02/2024 - a la fecha)

Esta investigación se da en el marco de un MATH-AmSud 2024 Project, El objetivo es desarrollar métodos de estimación de los parámetros del modelo WF mediante la densidad de transición que fue encontrada por el grupo de investigación.

Aplicada
4 horas semanales , Integrante del equipo
Equipo: SOSA ANDRES

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

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

Aplicada
5 horas semanales
Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Integrante del equipo
Equipo: SOSA ANDRES , BRIDA, J.G. , CAYSSIALS, G. , Alvarez E.
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Finanzas Cuantitativas (05/2019 - a la fecha)

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

Aplicada
10 horas semanales , Coordinador o Responsable
Equipo: SOSA ANDRES
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

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

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

mediano plazo.

Mixta

10 horas semanales , Integrante del equipo

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

Palabras clave: Aprendizaje automático;

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Estadística en el Deporte (08/2019 - a la fecha)

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

Aplicada

4 horas semanales , Integrante del equipo

Equipo: SOSA ANDRES , Alvarez-Castro, I

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN Y DESARROLLO

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

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

10 horas semanales

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

Otra

Coordinador o Responsable

En Marcha

Financiación:

Comisión Sectorial de Enseñanza, Uruguay, Apoyo financiero

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

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura /

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas / Didáctica

DOCENCIA

Contador Público - Economista (05/2019 - a la fecha)

Grado

Responsable

Asignaturas:

Cálculo 1, 56 horas, Teórico

Cálculo 1A, 56 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemáticas /

Contador Público - Licenciatura en Administración - Licenciatura en Economía (03/2022 - a la fecha)

Grado
Responsable
Asignaturas:
Cálculo I, 54 horas, Teórico-Práctico

Contador Público (08/2021 - a la fecha)

Grado
Responsable
Asignaturas:
Métodos Cuantitativos en Finanzas, 56 horas, Teórico-Práctico
Análisis de Datos para Administración, 10 horas, Teórico

Licenciatura en Estadística (08/2022 - a la fecha)

Grado
Responsable
Asignaturas:
Estadística en el Deporte, 56 horas, Teórico-Práctico
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Maestría en Finanzas (05/2020 - 05/2021)

Maestría
Invitado
Asignaturas:
Metodologías de la Investigación, 10 horas, Teórico

PASANTÍAS

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

Universidad de Valparaíso, Facultad de Ingeniería
40 horas semanales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

GESTIÓN ACADÉMICA

Integrante Suplente del Claustro de la Facultad de Ciencias Económicas y de Administración (10/2023 - a la fecha)

Participación en cogobierno 1 horas semanales

Comisión Asesora Llamado Profesor Adjunto Grado 3 de la Unidad Académica Métodos Cuantitativos para la Administración (05/2023 - 08/2025)

Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

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

Participación en consejos y comisiones 3 horas semanales

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

Gestión de la Investigación 2 horas semanales

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

Participación en consejos y comisiones 5 horas semanales

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

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

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

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

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

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

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

Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

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

Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

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

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

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

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

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

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

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

Facultad de Ciencias / Centro de Matemática

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

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

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

Funcionario/Empleado (07/2012 - 04/2017)

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

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

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

ACTIVIDADES

DOCENCIA

Licenciatura Bioqímica/Ciencias Biológicas (04/2017 - 05/2019)

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

Licenciatura en Recursos Naturales (04/2017 - 05/2019)

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

Licenciatura en Matemática (07/2012 - 04/2017)

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

1992 - LICENCIATURA EN CIENCIAS BIOLÓGICAS (07/2012 - 04/2017)

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

Licenciatura en Matemática (07/2012 - 04/2017)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Introducción al cálculo diferencial e integral, 8 horas, Teórico-Práctico
Areas de conocimiento:
Ingeniería y Tecnología / Otras Ingenierías y Tecnologías / Otras Ingenierías y Tecnologías /

1992 - LICENCIATURA EN CIENCIAS BIOLÓGICAS (07/2012 - 04/2017)

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

1992 - LICENCIATURA EN CIENCIAS BIOLÓGICAS (05/2009 - 07/2012)

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

1992 - LICENCIATURA EN CIENCIAS BIOLÓGICAS (05/2009 - 07/2012)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Matemática I, 6 horas, Práctico

1992 - LICENCIATURA EN CIENCIAS BIOLÓGICAS (05/2009 - 07/2012)

Grado
Asistente
Asignaturas:
Matemática I Segundo Semestre, 8 horas, Práctico

EXTENSIÓN

Proyecto Imaginary (01/2015 - 05/2019)

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 - 05/2019)

Facultad de Ciencias Participación en consejos y comisiones 2 horas semanales

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

Facultad de Ciencias, Centro de Matemática

Participación en consejos y comisiones

SECTOR EMPRESAS/PRIVADO - EMPRESA PRIVADA - URUGUAY

Banco Itaú

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

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

Analista de Crédito Wholesale 40 horas semanales

CARGA HORARIA

Carga horaria de docencia: 10 horas

Carga horaria de investigación: 20 horas

Carga horaria de formación RRHH: 2 horas

Carga horaria de extensión: 2 horas

Carga horaria de gestión: 6 horas

Producción científica/tecnológica

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

Desde la Licenciatura en Matemática investigo temas vinculados a las Finanzas Cuantitativas. El área es posible definirla como la aplicación de técnicas matemática y estadísticas relacionada al

análisis de los mercados financieros. Se basa en disciplinas como la teoría de la probabilidad, estadística, programación y ecuaciones diferenciales en derivadas parciales. Uno de sus objetivos principales es proporcionar modelos con el fin de obtener relaciones entre sus variables fundamentales. Los análisis en este campo de investigación permiten obtener conclusiones que de otra manera serían difíciles de encontrar, en especial al utilizar nuevas técnicas de almacenamiento de datos y al modelar diversas variables en forma simultánea, brindando la resolución de sistemas complejos. Los bancos comerciales, los fondos de inversión, las compañías de seguros y las agencias reguladoras aplican sus conocimientos en la valuación de activos y derivados financieros, la estructura de portafolio, la gestión de riesgos y la simulación de posibles escenarios. En la actualidad, los proyectos que estoy vinculado presentan distintas temáticas. Entre ellos se destacan el análisis de la estructura de datos financieros en Uruguay, la aplicación de modelos de volatilidad en la evolución temporal de los activos financieros y la valuación de derivados financieros en renta fija (modelación de tasas de interés) y en renta variable (opciones sobre índices bursátiles). 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

Comprehensive analysis of the crypto-assets market through multivariate analysis, clustering, and wavelet decomposition (Completo, 2025)

SOSA ANDRES, BRIDA, J.G., L. MORENO, Alvarez E.
Physica A Statistical Mechanics and its Applications, 2025
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 03784371
DOI: <https://doi.org/10.1016/j.physa.2024.130330>
WEB OF SCIENCE™ Scopus®

A note on pricing options on interest rates in Uruguay (Completo, 2024)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E., MAGNOU, G
Revista Brasileira de Economia, v.: 78 4, 2024
Medio de divulgación: Internet
E-ISSN: 00347140
Scopus®

SpICE: An Interpretable Method for Spatial Data (Completo, 2024)

SOSA ANDRES, L. MORENO, da Silva N, Alvarez-Castro, I
Computational Statistics, 2024
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 09434062
E-ISSN: 16139658
DOI: <https://doi.org/10.1007/s00180-024-01538-6>
WEB OF SCIENCE™ Scopus®

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

SOSA ANDRES, Alvarez E., BRIDA, J.G., L. MORENO
Quality & Quantity, v.: 57 p.:5355 - 5379, 2023
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: Springer
E-ISSN: 15737845
DOI: <https://doi.org/10.1007/s11135-022-01605-4>
Scopus®

Zero Black-Derman-Toy Model in Catastrophic Events: COVID-19 Performance Analysis (Completo, 2022) Trabajo relevante

SOSA ANDRES, KRZYZANOWSKI, G.
The Journal of Derivatives, v.: 30 1 , p.:103 - 118, 2022
Palabras clave: Zero Interest Rate Policy Black Derman Toy Model COVID-19
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Finanzas Cuantitativas
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 10741240
E-ISSN: 21688524
DOI: <https://doi.org/10.3905/jod.2022.1.164>
<https://jod.pm-research.com/>
Scopus

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

SOSA ANDRES, MORDECKI, E. , ILLANES, G.
Journal of Dynamics & Games, 2022
Palabras clave: Covid-19 pandemic public health epidemiology GDP forecasting Correlation analysis linear models
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 21646074
DOI: [10.3934/jdg.2022008](https://doi.org/10.3934/jdg.2022008)
Scopus

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

SOSA ANDRES, MORDECKI, E. , KRZYZANOWSKI, G.
The Journal of Fixed Income, v.: 31 4 , 2021
Palabras clave: Zero Interest Rate Policy Option Price Black Derman Toy Model 2007?2008 crisis in the United States
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada /
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas Cuantitativas
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: Institutional Investor Journals Umbrella
ISSN: 10598596
E-ISSN: 21688648
DOI: <https://doi.org/10.3905/jfi.2021.1.123>
<https://jfi.pm-research.com/>
Scopus

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

SOSA ANDRES, MORDECKI, E.
Brazilian Review of Econometrics, p.:285 - 302, 2020
Palabras clave: country risk index emerging markets sovereign debt Kalman filter
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: Brasil
ISSN: 25263722
E-ISSN: 19802447
DOI: <https://doi.org/10.12660/bre.v40n22020.80944>
<http://bibliotecadigital.fgv.br/ojs/index.php/bre>
Country risk index; Emerging markets; Sovereign debt; Kalman filter

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

SOSA ANDRES
Cuadernos de CIMBAGE, 2020
Palabras clave: Curvas de rendimiento Modelos de tasas de interés Bonos soberanos
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 16665112
E-ISSN: 16691830
WEB OF SCIENCE™ [latindex](#)

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

SOSA ANDRES, KALEMKERIAN, J.

Journal of Dynamics & Games, v.: 7 3, p.:225 - 237, 2020

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

Medio de divulgación: Internet

ISSN: 21646074

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

Scopus

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

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

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

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

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Cambridge University Press

ISSN: 18324274

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

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

Scopus

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

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

Journal of Dynamics & Games, v.: 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: 21646074

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

WEB OF SCIENCE™ Scopus

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

SOSA ANDRES

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

Palabras clave: Bonos soberanos valuación de activos de renta fija curvas de rendimiento en Uruguay

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 20072104

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

latindex

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

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

E-ISSN: 00347140

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

Scopus latindex

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

SOSA ANDRES

Compendium Cuadernos de Economía y Administración, v.: 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

E-ISSN: 13909894

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

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

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

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

Palabras clave: Riesgo Cambiario Crediticio economías parcialmente dolarizadas

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economías altamente dolarizadas

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 07975546

E-ISSN: 16880668

<http://www.bcu.gub.uy>

[latindex](#)

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

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

Risk Governance and Control Financial Markets & Institutions, v.: 3 2 2013, p.:58 - 73, 2013

Palabras clave: Risk Management Exchange Credit Risk partially dollarized financial system

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Papel

E-ISSN: 20774303

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

LIBROS

Trends in Mathematical Economics (Participación , 2016)

SOSA ANDRES, MORDECKI, E. Publicado

Editor/Compilador: Alberto A. Pinto, Elvio Accinelli Gamba, Athanasios N. Yannacopoulos, Carlos Hervés-Beloso

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>

Capítulos:
Modeling the uruguayan debt through gaussian Models
Página inicial 331, Página final 346

Enseñar Investigando (Participación , 2015)

SOSA ANDRES , BERGÓS , HUGO COITIÑO , CECILIA SILVARREY Publicado

Editor/Compilador: Carolina Cabrera; Marcela Ferreño; Amílcar Davyt
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

Capítulos:
ConCiencias en Malvín Norte: el barrio visto desde las ciencias
Página inicial 51, Página final 59

DOCUMENTOS DE TRABAJO

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

Completo
SOSA ANDRES , Alvarez-Castro, I , BARREIRO, L. , GRAU, M. , BATISTA, M.

Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Sport Analytics
Medio de divulgación: Internet
<https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/publicaciones/documentos-de-trabajo/>

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

Completo
SOSA ANDRES

<https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/publicaciones/notas-de-reflexion-aportes-sobre-covid-19/>
Medio de divulgación: Internet
<http://www.iesta.edu.uy/>

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

Completo
SOSA ANDRES

Montevideo
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /
Medio de divulgación: Internet
<http://www.iesta.edu.uy/>

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

Completo
SOSA ANDRES , MORDECKI, E.
Serie: 1,
Palabras clave: Simulación
Áreas 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, G. , PENA, A.

Serie: -,

<http://www.bcu.gub.uy>

Areas de conocimiento:

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

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

Medio de divulgación: Internet

<http://www.bcu.gub.uy>

PUBLICACIÓN DE TRABAJOS PRESENTADOS EN EVENTOS

Disaster Risk Reduction (2017)

SOSA ANDRES , Santos Leonardo , Londe Luciana , Aguilar Viviana , Obregón Guillermo

Publicado

Completo

Evento: Internacional

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

Ciudad: São José dos Campos

Año del evento: 2017

Anales/Proceedings:Final Report: Mathematics Threat Hazard

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

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Medio de divulgación: Papel

Fecha de publicación: 01/12/2016

Lugar de publicación: Montevideo

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

Búsqueda

Revista

SOSA ANDRES

Palabras clave: Desocupación. Morosidad.

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Fecha de publicación: 12/06/2014

Lugar de publicación: Montevideo

<http://www.busqueda.com.uy/>

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

Evaluaciones

EVALUACIÓN DE PUBLICACIONES

REVISIONES

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

Tipo de publicación: Revista

Cantidad: Menos de 5

Revista Sociedad y Economía (2018 / 2018)

Tipo de publicación: Revista

Cantidad: Menos de 5

Brazilian Journal of Probability and Statistics (2015 / 2016)

Tipo de publicación: Revista

Cantidad: Menos de 5

JURADO DE TESIS

Licenciatura en Estadística (2024)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

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

Nivel de formación: Grado

Maestría en Ciencia de Datos y Aprendizaje Automático (2024)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería , Uruguay

Nivel de formación: Maestría

Maestría en Data Science (2023)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad Tecnológica / Universidad Tecnológica , Uruguay

Nivel de formación: Maestría

Maestría en Finanzas (2022)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

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

Nivel de formación: Maestría

Maestría en Matemática (2020)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias , Uruguay

Nivel de formación: Maestría

Licenciatura en Matemática (2017)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias , Uruguay

Nivel de formación: Grado

Maestría en Ingeniería Matemática (2015)

Jurado de mesa de evaluación de tesis

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería , Uruguay

Nivel de formación: Maestría

Formación de RRHH

TUTORÍAS CONCLUIDAS

POSGRADO

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

Tesis de maestría
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Programa: Maestría en Finanzas
Tipo de orientación: Tutor único o principal
Nombre del orientado: Alejandro Crossa
País: Uruguay
Palabras Clave: Modelos de Optimización de Portafolios

GRADO

Análisis estadístico de la posesión del balón en los Mundiales de fútbol Catar 2022 y Australia/Nueva Zelanda 2023 (2024 - 2025)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Instituto de Estadística , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad (SOSA ANDRES , Alvarez-Castro, I)
Nombre del orientado: Martín Grau-Perez
País: Uruguay
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

TUTORÍAS EN MARCHA

POSGRADO

Riesgo de Default sectorial en el sistema bancario uruguayo: evidencia empírica y predicción (2024)

Tesis de maestría
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Instituto de Economía , Uruguay
Programa: Maestría en Economía
Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad (SOSA ANDRES , Alvarez-Castro, I)
Nombre del orientado: Carolina Caldeiro
País/Idioma: Uruguay,
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Otros datos relevantes

PREMIOS, HONORES Y TÍTULOS

Premio Jorge Blanco (2021)

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

PRESENTACIONES EN EVENTOS

V Jornadas Interdisciplinarias en Sistemas Complejos (2024)

Encuentro
Tendencias Recientes en Modelos de Volatilidad
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Alcance geográfico: Regional

12th World Congress Bachelier Finance Society (2024)

Congreso
Dynkin Games for Lévy Processes

Brasil
Tipo de participación: Expositor oral
Alcance geográfico: Internacional

VI Jornadas Interdisciplinarias en Sistemas Complejos (2024)

Encuentro
Network Analysis of Returns , Volatility and Trading Volume in the Crypto-asset Market
Argentina
Tipo de participación: Expositor oral
Alcance geográfico: Regional

Latin American Congress on Industrial and Applied Mathematics (2023)

Congreso
Zero Black Derman Toy Model
Brasil
Tipo de participación: Expositor oral
Alcance geográfico: Internacional

Seminario del Instituto de Economía (2023)

Seminario
Modelos de Valuación de Activos de Renta Fija
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Alcance geográfico: Local

Jornadas Académicas Facultad de Ciencias Económicas y de Administración (2023)

Encuentro
Desde las Finanzas a los Juegos de Dynkin
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral

Seminario del Instituto de Estadística (2022)

Seminario
Aplicaciones del modelo Gaussian Affine Term Structure Multidimensional en la deuda soberana uruguaya
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Instituto de Estadística

Congreso Interdisciplinario COVID 19, pandemia y pospandemia (2022)

Congreso
El Impacto de la Crisis Sanitaria del COVID-19 en las Proyecciones de Crecimiento Económico
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Espacio Interdisciplinario de la Universidad de la República

XXII Jornadas Latinoamericanas de Teoría Económica (2022)

Encuentro
Modelo Zero Black Derman Toy
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Asociación Latinoamericana de Teoría Económica

Seminario de Probabilidad y Estadística (2021)

Seminario
Análisis estadístico de los Tiros Ejecutados en la Liga Uruguaya de Basketball 2019-2020
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 2
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística (2021)

Congreso
Una Propuesta Dinámica del Índice Riesgo País en Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Sociedad Uruguaya de Estadística

VI Jornadas de Estadística Aplicada (2021)

Encuentro
Dos Proyectos de Análisis Estadístico en la Liga Uruguaya de Basquetball
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Centro Universitario Regional del Este

Seminario de Probabilidad y Estadística (2020)

Seminario
Una mirada sobre los mercados financieros en el contexto de la pandemia derivada por COVID-19.
Momentos de gran volatilidad, datos actuales y proyecciones.
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Seminario del Instituto de Estadística (2020)

Seminario
Reporte sobre los mercados financieros en el actual contexto de pandemia derivada de la enfermedad por COVID-19
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario de Investigación Económica (2020)

Seminario
Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. Caso de estudio: Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay

Grupo de Estudio Estadística en el Deporte (2020)

Seminario
Análisis de tres artículos científicos en el área Sport Analytics
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario Grupo de Investigación en Dinámica Económica (2020)

Seminario
El multiplicador de los ingresos de los sectores institucionales y la incidencia de sus relaciones: Una metodología macroeconómica de entrada-salida y un ejercicio para la economía mexicana
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario del Instituto de Estadística (2020)

Seminario
Análisis estadístico de los Tiros Ejecutados en la Liga Uruguaya de Basketball 2019-2020
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Jornadas Académicas de Facultad de Ciencias y Administración (2019)

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

Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

V Jornadas de Estadística Aplicada (2019)

Seminario
Análisis de los métodos de estimación de curvas de rendimiento en la deuda soberana aplicados en Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Centro Universitario Regional del Este

V Jornadas Argentinas de Econometría (2019)

Congreso
Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana
Argentina
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Universidad de Buenos Aires

Seminario Instituto de Estadística (2019)

Seminario
Modelos estadísticos y estocásticos en curvas de rendimientos
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Seminario Instituto de Economía (2019)

Seminario
Desde el enfoque estático al enfoque dinámico en el análisis de las curvas de rendimiento en la deuda soberana. Caso de estudio: Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Taller Interdisciplinario en Sistemas Complejos (2019)

Taller
Dependencia de Largo Alcance en Series Financieras
Argentina
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Universidad de Buenos Aires

Coloquio Uruguayo de Matemática (2019)

Congreso
Análisis dinámico de la deuda soberana
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias

Seminario Grupo de Investigación en Dinámica Económica (2019)

Seminario
Modelos estadísticos y estocásticos en curvas de rendimientos
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

Grupo de Estudio Estadística en el Deporte (2019)

Taller
How to improve a team position in the FIFA ranking? A simulation study
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y de Administración

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

Congreso

Yield Curve Modelling in emerging markets: Uruguay case study

Uruguay

Tipo de participación: Poster

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

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Seminario Departamento de Economía (2018)

Seminario

Modelos estocásticos en tasas de interés

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Sociales

IV Jornadas de Estadística Aplicada (2017)

Encuentro

Las bondades del filtro de Kalman

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

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

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

III Jornadas Argentinas de Econometría (2016)

Seminario

Análisis Espectral del Mercado Laboral en Uruguay

Argentina

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 16 Palabras Clave: Análisis Espectral

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

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

Congreso

Modeling the Uruguayan Sovereign Debt

Colombia

Tipo de participación: Expositor oral Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Imaginary Congress 2016 (2016)

Congreso

Mathematical education TV program

Alemania

Tipo de participación: Expositor oral Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Difusión

III Jornadas de Estadística Aplicada (2015)

Seminario

Tasas de interés y volatilidad implícita

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 16 Palabras Clave: Interest Rate

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Grupo de Estudio de Educación Matemática (2015)

Taller

Introducción al libro: Mathematical problem solving -- Alan Schoenfeld

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 2

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

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura

Ciencias Sociales / Psicología / Psicología especial

Research in Options (2014)

Congreso

Dynamic modeling of interest rate for the Uruguayan debt

Brasil

Tipo de participación: Poster

Carga horaria: 5

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

Dynamic Modeling, Interest Rate.

Areas de conocimiento:

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

II Jornadas de Estadística Aplicada (2014)

Seminario

Tasas de interés y volatilidad implícita.

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 5

Nombre de la institución promotora: Laboratorio de Probabilidad y Estadística de la Facultad de

Ingeniería -- Polo de Desarrollo Universitario Modelización y Análisis de Recursos Naturales

Palabras Clave: Tasas de interés. Volatilidad Implícita

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Cálculo Estocástico

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Tasa de Interés

XXVIII Jornadas Anuales de Economía (2013)

Congreso

Modelo Macroeconómico del Riesgo de Crédito en Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

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

Crédito de un factor

Areas de conocimiento:

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

XXVII Jornadas Anuales de Economía (2012)

Congreso

Riesgo Cambiario Crediticio: Medidas e Implicaciones

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

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

Crediticio

Areas de conocimiento:

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

Seminario de Gestión Bancaria (2012)

Seminario

Mercados de Derivados: Métodos de Valuación de Instrumentos Financieros

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

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

Derivados

Areas de conocimiento:

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

Seminario de Finanzas (2011)

Seminario

Valuación de opciones en Mercados Incompletos

España

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Universidad Autónoma de Madrid
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

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
Clave: Transformada de Fourier

Áreas de conocimiento:

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

CONSTRUCCIÓN INSTITUCIONAL

Participo en la gestión académica en la Universidad de la República, anteriormente en Facultad de Ciencias en la Comisión Directiva del Centro de Matemática durante dos años y actualmente integro (suplente) del Claustro de la Facultad de Ciencias Económicas y de Administración. Fui coordinador durante varios años del Seminario de Probabilidad y Estadística (<https://pye.cmat.edu.uy/seminarios>).

Información adicional

Indicadores de producción

ACTIVIDADES	41
Líneas de investigación	5
Proyectos Investigación Desarrollo	1
Docencia	14
Extensión	3
Gestión Académica	15
Pasantía	3
PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA	27
Artículos publicados en revistas científicas	17
Completo	17
Trabajos en eventos	1

Libros y Capítulos	2
Capítulos de libro publicado	2
Textos en periódicos	2
Revistas	2
Documentos de trabajo	5
Completo	5
EVALUACIONES	10
Evaluación de publicaciones	3
Jurado de tesis	7
FORMACIÓN RRHH	3
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas	2
Tesis de maestría	1
Tesis/Monografía de grado	1
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones en marcha	1
Tesis de maestría	1