



ERNESTO MORDECKI
PUPKO
Dr

mordecki@cmat.edu.uy
Facultad de Ciencias. Centro
de Matemática. Iguá 4225.
CP 11400 - Montevideo - U
ruguay
25252522

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

Fecha de publicación: 01/06/2020
Última actualización: 16/12/2019

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

Dirección: Centro de Matemática / Iguá 4225 / 11400 / Montevideo, Montevideo, Uruguay

Teléfono: (598) 25252522 / 122

Correo electrónico/Sitio Web: mordecki@cmat.edu.uy

Formación

Formación académica

CONCLUIDA

DOCTORADO

Physics and Mathematics (1991 - 1994)

Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences, Rusia

Título de la disertación/tesis/defensa: Convergencia de experimentos estadísticos y procesos de Hellinger (en ruso)

Tutor/es: Albert Nicolaievich Shiryayev

Obtención del título: 1994

Financiación:

Russian Academy of Sciences, Rusia

Palabras Clave: Estadística Procesos Estocásticos

Áreas de conocimiento:

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

MAESTRÍA

Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA) (1989 - 1990)

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

Título de la disertación/tesis/defensa: Teorema Central del Límite para Martingalas Fuertes Biparamétricas

Tutor/es: Enrique Mario Cabaña

Obtención del título: 1990

Palabras Clave: Convergencia de Procesos Estocásticos Martingalas

Áreas de conocimiento:

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

GRADO

Licenciatura en Matemática (1985 - 1989)

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

Título de la disertación/tesis/defensa: Monografía I: Estimación de densidades mediante series. Monografía II: Estimación de densidades mediante splines

Tutor/es: Ricardo Fraiman

Obtención del título: 1989

Palabras Clave: Matemática

Áreas de conocimiento:

Idiomas

Inglés

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

Ruso

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

Francés

Entiende bien / Habla regular / Lee bien / Escribe regular

Portugués

Entiende bien / Habla bien / Lee bien / Escribe regular

Areas de actuación

CIENCIAS NATURALES Y EXACTAS

Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos, optimización, estadística y aplicaciones

Actuación profesional

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

Facultad de Ciencias - UDeLaR

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (12/2007 - a la fecha)

Profesor Titular ,40 horas semanales / Dedicación total
Centro de Matematica
Escalafón: Docente
Grado: Grado 5
Cargo: Efectivo

Funcionario/Empleado (01/1998 - 12/2007)

Profesor Agregado ,40 horas semanales / Dedicación total
Centro de Matematica
Escalafón: Docente
Grado: Grado 4
Cargo: Efectivo

Funcionario/Empleado (01/1990 - 12/1997)

Profesor Adjunto ,20 horas semanales
Centro de Matemática
Escalafón: Docente
Grado: Grado 3
Cargo: Efectivo

Funcionario/Empleado (01/1987 - 12/1989)

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

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

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (01/1997 - 12/1997)

Profesor titular (efectivo) ,40 horas semanales
Matemática I
Escalafón: Docente
Grado: Grado 5
Cargo: Efectivo

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

Facultad de Ingeniería - UDeLaR

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (01/1990 - 12/1996)

Profesor adjunto (efectivo) ,40 horas semanales
Facultad de Ingeniería, Instituto de Matemática y Estadística 'Rafael Laguardia'
Escalafón: Docente
Grado: Grado 1
Cargo: Interino

Funcionario/Empleado (01/1986 - 12/1990)

Asistente interino ,40 horas semanales
Instituto de Matemática y Estadística 'Rafael Laguardia'
Escalafón: Docente
Grado: Grado 1
Cargo: Interino

Funcionario/Empleado (01/1982 - 12/1986)

Ayudante interino ,20 horas semanales
Facultad de Ingeniería, Instituto de Matemática y Estadística 'Rafael Laguardia'
Escalafón: Docente
Grado: Grado 1
Cargo: Interino

SECTOR EXTRANJERO/INTERNACIONAL/OTROS - RUSIA

Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Becario (02/1991 - 12/1994) Trabajo relevante

Estudiante de Doctorado ,40 horas semanales / Dedicación total

CARGA HORARIA

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

Producción científica/tecnológica

El area de trabajo podria denominarse "procesos estocasticos y aplicaciones". Mis primeros trabajos, relacionados con la tesis doctoral, tratan de estadistica de procesos aleatorios. Allí se obtuvieron resultados de Convergencia de procesos de verosimilitud del tipo Local Asymptotical Mixed Normality (LAMN) en terminos de las características previsibles de los procesos estocasticos

involucrados. A lo largo de mi carrera he seguido trabajando también en temas de estadística de procesos aleatorios. Mi tema de interés central es la parada óptima de procesos y su aplicación en finanzas. Allí obtuve resultados para las opciones integrales, y luego para los procesos de Levy. Relacionado con este tema, obtuve fórmulas explícitas para la probabilidad de ruina (que es equivalente a la distribución del máximo) para diversas clases de procesos de Levy. Me he interesado también por el cálculo numérico para ecuaciones diferenciales estocásticas. Con varios estudiantes de maestría hemos trabajado con datos financieros: en petróleo con el objetivo de valorar seguros ante variación de precios; en cotizaciones de tipo de cambio, para cuantificar el riesgo del tipo de cambio; en la evolución del índice SP500 con el objetivo de obtener modelos de valuación de opciones que combinen la información histórica y la de riesgo neutral. Me interesa también la modelación estadística en telecomunicaciones, el análisis de sistemas de gran tamaño y los modelos límites que se obtienen, así como las velocidades de aproximación de esta modelación (aproximaciones débiles y grandes desvíos). Trabajo también en modelación estocástica de estilos musicales.

Producción bibliográfica

ARTÍCULOS PUBLICADOS

ARBITRADOS

Optimal stopping of Brownian motion with broken drift (Completo, 2019)

MORDECKI, E. , Paavo Salminen
High Frequency, v.: 2 2 , p.:113 - 120, 2019
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 24706981
DOI: <https://doi.org/10.1002/hf2.10034>

Optimal stopping of oscillating Brownian motion (Completo, 2019)

MORDECKI, E. , Paavo Salminen
Electronic Communications in Probability, v.: 24 1 , p.:1 - 12, 2019
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 1083589X
Scopus[®] WEB OF SCIENCE[™]

Two consistent estimators for the skew Brownian motion (Completo, 2019)

MORDECKI, E. , Antoine Lejay , Soledad Torres
ESAIM - Probability and Statistics (E), v.: 23 p.:567 - 583, 2019
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: Francia
ISSN: 12623318
DOI: <https://doi.org/10.1051/ps/2018018>
<https://www.esaim-ps.org/>
Scopus[®]

Level sets and drift estimation for reflected Brownian motion with drift (Completo, 2019)

MORDECKI, E. , FRAIMAN, R. , Cholaquidis, A. , Papalardo, C.
Statistica Sinica, 2019
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: China
ISSN: 10170405
DOI: [DOI: 10.5705/ss.202018.0211](https://doi.org/10.5705/ss.202018.0211)
Scopus[®] WEB OF SCIENCE[™]

Skewed Levy Models and Implied Volatility Skew (Completo, 2018)

MORDECKI, E. , F. De Olivera , Jose Fajardo Barbachan
International Journal Of Theoretical And Applied Finance, v.: 21 02 , 2018
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 02190249
DOI: [10.1142/S0219024918500036](https://doi.org/10.1142/S0219024918500036)
<https://www.worldscientific.com/worldscinet/ijtaf>

Scopus

Pricing bond options in emerging markets: a case study (Completo, 2018)

MORDECKI, E. , Andrés Sosa , Guillermo Magnou
Journal of Dynamics and Games, v.: 5 1 , p.:21 - 30, 2018
Medio de divulgación: Papel
Lugar de publicación: USA
ISSN: 21646066
DOI: [10.3934/jdg.2018003](https://doi.org/10.3934/jdg.2018003)
<http://aimsciences.org/journal/2164-6066>

Asymptotic normality of high level-large time crossings of a Gaussian process (Completo, 2018)

MORDECKI, E. , Federico Dalmao , J.R. León , Stephane Mourareaue
Stochastic Processes and their Applications, 2018
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 03044149
DOI: <https://doi.org/10.1016/j.spa.2018.05.003>
<https://www.sciencedirect.com/science/article/abs/pii/S030441491830156X>

Scopus WEB OF SCIENCE™

On optimal stopping of multidimensional diffusions (Completo, 2018)

MORDECKI, E. , Paavo Salminen , Soren Christensen , CROCCE, F.
Stochastic Processes and their Applications, 2018
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 03044149
DOI: <https://doi.org/10.1016/j.spa.2018.07.014>
<https://www.sciencedirect.com/science/article/abs/pii/S0304414918303612>

Scopus WEB OF SCIENCE™

A non-iterative algorithm for generalized pig games (Completo, 2018)

MORDECKI, E. , CROCCE
Journal of Dynamics and Games, v.: 5 4 , p.:331 - 341, 2018
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 21646066
DOI: [10.3934/jdg.2018020](https://doi.org/10.3934/jdg.2018020)
<http://aimsciences.org/article/doi/10.3934/jdg.2018020>

A finite exact algorithm to solve a dice game (Completo, 2016)

MORDECKI, E. , CROCCE
Journal of Applied Probability, v.: 53 1 , p.:91 - 105, 2016
Palabras clave: Dice games
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad
Medio de divulgación: Internet
Lugar de publicación: UK
ISSN: 00219002
DOI: <https://doi.org/10.1017/jpr.2015.11>
<https://www.cambridge.org/core/journals/journal-of-applied-probability>

Scopus WEB OF SCIENCE™

Optimal stopping for Levy processes with one-sided solutions. (Completo, 2016)

MORDECKI, E. , Yuliya Mishura
SIAM Journal on Control and Optimization, v.: 54 5 , p.:2553 - 2567, 2016
Medio de divulgación: Internet
ISSN: 03630129
DOI: [10.1137/15M1032144](https://doi.org/10.1137/15M1032144)
<https://www.siam.org/Publications/Journals/SIAM-Journal-on-Control-and-Optimization-SICON>

Scopus WEB OF SCIENCE™

Robustness of Cucker-Smale flocking model (Completo, 2015)

E. CANALE , DALMAO, F. , MORDECKI, E. , M. O. SOUZA
IET Control Theory and Applications, v.: 9 3 , p.:346 - 350, 2015

Areas de conocimiento:

Ingeniería y Tecnología / Ingeniería Eléctrica, Ingeniería Electrónica e Ingeniería de la Información /
Control Automático y Robótica / Control Distribuido

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 17518644

DOI: [10.1049/iet-cta.2014.0496](https://doi.org/10.1049/iet-cta.2014.0496)

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Rice Formula for processes with jumps and applications (Completo, 2015)

MORDECKI, E. , DALMAO, F.

Extremes, v.: 18 1 , p.:15 - 35, 2015

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 13861999

DOI: [0.1007/s10687-014-0200-2](https://doi.org/0.1007/s10687-014-0200-2)

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Is a Brownian Motion Skew? (Completo, 2014)

ANTONIE LEJAY , MORDECKI, E. , SOLEDAD TORRES

Scandinavian Journal of Statistics, v.: 41 2 , p.:346 - 364, 2014

Palabras clave: Skew Brownian Motion

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 03036898

DOI: [10.1111/sjos.12033](https://doi.org/10.1111/sjos.12033)

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

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Explicit solutions in one-sided optimal stopping problems for one-dimensional diffusions (Completo, 2014)

CROCCE, F. , MORDECKI, E.

Stochastics An International Journal of Probability and Stochastic Processes, v.: 86 3 , p.:491 - 509,
2014

Palabras clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 17442508

DOI: [10.1080/17442508.2013.837467](https://doi.org/10.1080/17442508.2013.837467)

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

WEB OF SCIENCE™

Skewness premium with Lévy processes (Completo, 2014)

FAJARDO, J. , MORDECKI, E.

Quantitative Finance, v.: 14 9 , p.:1619 - 1626, 2014

Palabras clave: Matematica Financiera

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 14697688

DOI: [10.1080/14697688.2011.618809](https://doi.org/10.1080/14697688.2011.618809)

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

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Characterization and estimation of exchange credit risk in partially-dollarized economies (Completo, 2013)

MORDECKI, E. , ALEJANDRO PENA , ANDRES SOSA

Revista de Economía, v.: 20 2 , p.:61 - 91, 2013

Palabras clave: Finanzas

Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /
Medio de divulgación: Papel
Lugar de publicación: Uruguay
ISSN: 07975546

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

MORDECKI, E. , ALEJANDRO PENA , ANDRES SOSA
Risk Governance & Control: Financial Markets & Institutions, v.: 3 p.:58 - 72, 2013
Palabras clave: Credit Risk
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Riesgo de credito
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 20774303

Hierarchical Cucker-Smale model subject to random failure (Completo, 2012)

MORDECKI, E. , DALMAO, F.
IEEE Transactions on Automatic Control, v.: 57 7 , p.:1789 - 1793, 2012
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Flocking
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 00189286
<http://www.nd.edu/~ieeetac/>
Scopus® WEB OF SCIENCE™

CuckerSmale Flocking Under Hierarchical Leadership and Random Interactions (Completo, 2011)

DALMAO, F. , MORDECKI, E.
SIAM Journal on Applied Mathematics, v.: 71 4 , p.:1307 - 1316, 2011
Palabras clave: Flocking Dynamical System Random noise
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Control
Medio de divulgación: Papel
Lugar de publicación: EEUU
ISSN: 00361399
DOI: [10.1137/100785910](https://doi.org/10.1137/100785910)
<http://dx.doi.org/10.1137/100785910>
Scopus® WEB OF SCIENCE™

Market symmetry in time-changed Brownian models (Completo, 2010)

MORDECKI, E. , FAJARDO, J.
Finance Research Letters , v.: 7 1 , p.:53 - 59, 2010
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 15446123
DOI: [10.1016/j.frl.2009.11.003](https://doi.org/10.1016/j.frl.2009.11.003)
<http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S1544612309000580>
Scopus® WEB OF SCIENCE™

Flocking in noisy environments (Completo, 2008) Trabajo relevante

CUCKER, F. , MORDECKI, E.
Journal de Mathématiques Pures et Appliquées, v.: 89 3 , p.:278 - 296, 2008
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Sistemas Complejos
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 00217824
Scopus® WEB OF SCIENCE™

Adaptive Weak Approximation of Diffusions with Jumps (Completo, 2008)

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

SIAM Journal on Numerical Analysis, v.: 46 4 , p.:1732 - 1768, 2008

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Análisis Numérico

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Estados Unidos

ISSN: 00361429

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

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Wiener-Hopf factorization for Levy processes having negative jumps with rational transforms

(Completo, 2008) Trabajo relevante

LEWIS, A. , MORDECKI, E.

Advances in Applied Probability, v.: 45 1 , p.:118 - 134, 2008

Palabras clave: Procesos de Levy

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Sheffield

ISSN: 00018678

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Duality and Symmetry with Time-Changed Levy processes (Completo, 2008)

MORDECKI, E. , FAJARDO, J.

Brazilian Journal of Econometrics, v.: 28 1 , p.:95 - 110, 2008

Palabras clave: Finanzas

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Rio de Janeiro

ISSN: 19802447

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

Optimal Stopping of Hunt and Levy Processes (Completo, 2007)

MORDECKI, E. , SALMINEN, P.

Stochastics and Stochastics Reports, v.: 79 3-4 , p.:233 - 251, 2007

Palabras clave: Optimal stopping Hunt Processes

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Great Britain

ISSN: 10451129

Symmetry and Duality in Levy Markets (Completo, 2006) Trabajo relevante

FAJARDO, J. , MORDECKI, E.

Quantitative Finance, v.: 6 3 , p.:219 - 227, 2006

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 14697688

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Pricing Derivatives on Two Dimensional Levy Processes (Completo, 2006)

MORDECKI, E. , FAJARDO, J.

International Journal Of Theoretical And Applied Finance, v.: 9 2 , p.:185 - 197, 2006

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Finanzas Matemáticas

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 02190249

Scopus®

Smoothing the paths and weak approximation of the occupation measure of Levy processes (Completo,

2006)

MORDECKI, E. , WSCHEBOR, M
Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 11 p.:23 - 40, 2006
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /
Medio de divulgación: Papel
Lugar de publicación: Montevideo
ISSN: 07971443

Approximation of the occupation measure of Levy processes (Completo, 2005)

MORDECKI, E. , WSCHEBOR, M.
Comptes Rendus de L'Academie des Sciences Serie III-Sciences de la Vie-Life Sciences, v.: 340 I,
p.:605 - 610, 2005
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de Procesos
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 07644469

SST anomaly variability in Southwestern Atlantic and El Nino/Southern oscillation (Completo, 2004)

SEVEROV, D. , MORDECKI, E. , PSHENNIKOVA, V.
Advances in Space Research, v.: 33 p.:343 - 347, 2004
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Tierra y relacionadas con el Medio Ambiente /
Investigación Climatológica /
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 02731177

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Ruin probabilities for a Levy process with mixed exponential negative jumps (Completo, 2003)

MORDECKI, E.
Theory of Probability and its Applications, v.: 48 p.:188 - 194, 2003
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos de Lévy
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 0040585X

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Optimal stopping and perpetual options for Levy processes (Completo, 2002)

Trabajo relevante

MORDECKI, E.
Finance and Stochastics, v.: 6 4 , p.:473 - 493, 2002
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 09492984

DOI: [10.1007/s007800200070](https://doi.org/10.1007/s007800200070)

<http://www.springerlink.com/content/wxpde5auu82wlmn/>

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Bounds on option prices for semimartingale market models (Completo, 2002)

GUSHCHIN, A. A. , MORDECKI, E.
Proceedings of the Steklov Institute of Mathematics, v.: 237 p.:80 - 122, 2002
Palabras clave: Matematica Financiera Statistical Experiments
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera
Medio de divulgación: Papel
ISSN: 00815438

Perpetual Options for Levy Processes in the Bachelier Model (Completo, 2002)

MORDECKI, E.
Proceedings of the Steklov Institute of Mathematics, v.: 237 p.:256 - 264, 2002

Palabras clave: Parada óptima Procesos de Levy

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 00815438

The distribution of the maximum of a Levy processes with positive jumps of phase-type (Completo, 2002)

MORDECKI, E.

Theory of Stochastic Processes, v.: 8 24 3-4, p.:309 - 316, 2002

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 03213900

Russian Options for a Difussion with Negative Jumps (Completo, 2001)

MORDECKI, E. , WALTER MOREIRA

Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 9 p.:37 - 51, 2001

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 07971443

Necessary conditions for stable convergence of semimartingales (Completo, 1999)

MORDECKI, E.

Theory of Probability and its Applications, v.: 44 1 , p.:229 - 232, 1999

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Convergencia débil de procesos

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 0040585X

Scopus' WEB OF SCIENCE™

Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps (Completo, 1999)

MORDECKI, E.

Finance and Stochastics, v.: 2 p.:227 - 238, 1999

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 09492984

Optimal stopping and Maximal Inequalities for Poisson Processes (Completo, 1999)

MORDECKI, E. , KRAMKOV, D.

Publicaciones Matemáticas Del Uruguay, v.: 8 p.:153 - 178, 1999

Palabras clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 07971443

Optimal Stopping Rules for Compound Poisson Processes (Completo, 1997)

MORDECKI, E.

, v.: 7 p.:55 - 66, 1997

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

ISSN:

Asymptotic mixed normality and Hellinger Processes (Completo, 1994)

MORDECKI, E.

Stochastics and Stochastics Reports, v.: 48 p.:129 - 143, 1994

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 10451129

Integral Option (Completo, 1994)

MORDECKI, E. , KRAMKOV, D.

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

Palabras clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 0040585X

WEB OF SCIENCE*

Necessary Conditions for Stable Convergence of Semimartingales (Completo, 1993)

MORDECKI, E.

Russian Mathematical Surveys, v.: 48 p.:193 - 194, 1993

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Convergencia débil de procesos

Medio de divulgación: Papel

ISSN: 00360279

WEB OF SCIENCE*

Convergence of Binary Statistical Experiments and Hellinger Processes (Completo, 1992)

MORDECKI, E.

Russian Mathematical Surveys, v.: 47 p.:223 - 224, 1992

Palabras clave: Estadística de procesos aleatorios

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Moscu

ISSN: 00360279

WEB OF SCIENCE*

ARTÍCULOS ACEPTADOS

ARBITRADOS

QoS provision in a dynamic channel allocation based on admission control decisions (Completo, 2019)

MORDECKI, E. , Claudina Rattaro , Laura Aspirot , Pablo Belzarena

ACM Transactions on Modeling and Performance Evaluation of Computing Systems (TOMPECS), 2019

Medio de divulgación: Internet

Fecha de aceptación: 18/11/2019

ISSN: 23763639

<https://tompecs.acm.org/>

LIBROS

Trends in Mathematical Economics (Participación , 2016)

MORDECKI, E. , SOSA ANDRES

Edición: ,

Editorial: Springer, Switzerland

Tipo de publicación: Investigación

DOI: [DOI: 10.1007/978-3-319-32543-9_17](https://doi.org/10.1007/978-3-319-32543-9_17)

Referado

Palabras clave: Bonds

Areas de conocimiento:

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

Medio de divulgación: Papel

ISSN/ISBN: 978-3-319-32541-5

<https://www.springer.com/la/book/9783319325415>

Capítulos:

Modelling the Uruguayan Debt Through Gaussians Models

Organizadores: Pinto, A.A., Accinelli Gamba, E., Yannacopoulos, A.N., Hervés-Beloso, C. (Eds.)

Página inicial 331, Página final 346

Trends in Mathematical Economics (Participación , 2016)

MORDECKI, E. , F. De Olivera

Edición: .

Editorial: Springer, Switzerland

Tipo de publicación: Investigación

DOI: [DOI: 10.1007/978-3-319-32543-9_6](https://doi.org/10.1007/978-3-319-32543-9_6)

Referado

Palabras clave: Option greeks

Medio de divulgación: Papel

ISSN/ISBN: 978-3-319-32541-5

Capítulos:

Computing Greeks for Levy Models: The Fourier Transform Approach

Organizadores: Pinto, A.A., Accinelli Gamba, E., Yannacopoulos, A.N., Hervés-Beloso, C. (Eds.)

Página inicial 99, Página final 121

Calculo diferencial e integral con funciones de varias variables (Libro publicado Texto integral , 2015)

A. ABELLA , MORDECKI, E.

Número de volúmenes: 1

Número de páginas: 168

Edición: 1,

Editorial: Dirac - Facultad de Ciencias, Montevideo

Tipo de publicación: Material didáctico

Referado

Palabras clave: FUNCIONES DE VARIAS VARIABLES CALCULO DIFERENCIAL CALCULO INTEGRAL

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Calculo diferencial e integral

Medio de divulgación: Papel

ISSN/ISBN: 9789974012448

Financiación/Cooperación:

Facultad de Ciencias - UDeLaR / Apoyo financiero, Uruguay

Jose Luis Massera: Ciencia y compromiso social (Libro compilado Libro , 2010)

MORDECKI, E. , MARKARIAN, R.

Número de volúmenes: 800

Número de páginas: 364

Edición: 1,

Editorial: Orbe Libros, Montevideo

Palabras clave: Historia de la matematica

Areas de conocimiento:

Humanidades / Filosofía, Ética y Religión / Filosofía, Historia y Filosofía de la Ciencia y la Tecnología / Matematica

Medio de divulgación: Papel

ISSN/ISBN: 9974661615

Financiación/Cooperación:

Programa de Desarrollo de las Ciencias Básicas / Apoyo financiero, Uruguay

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

Teoria de la Probabilidad (Libro publicado Texto integral , 2008)

PETROV, V.V. , MORDECKI, E.

Número de volúmenes: 1

Número de páginas: 272
Edición: 2,
Editorial: DIRAC- Facultad de Ciencias, Montevideo
Tipo de publicación: Material didáctico
Referado
Palabras clave: Matematica Probabilidad Procesos Estocasticos
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad
Medio de divulgación: Papel
ISSN/ISBN: 9974004337
Financiación/Cooperación:
Comisión Sectorial de Investigación Científica - UDeLaR / Apoyo financiero, Uruguay
Segunda Edicion

Teoría de Probabilidades (Libro publicado Texto integral , 2002) Trabajo relevante

PETROV, V , MORDECKI, E.
Número de volúmenes: 1
Número de páginas: 286
Edición: ,
Editorial: Editorial URSS, Moscu
Tipo de publicación: Material didáctico
Palabras clave: Probabilidad Procesos Estocasticos
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad
Medio de divulgación: Papel
ISSN/ISBN: 5836004900

DOCUMENTOS DE TRABAJO

On the number of open knight's tours (2015)

Completo
MORDECKI, E. , CANCELA, HÉCTOR

Medio de divulgación: Internet
<https://arxiv.org/abs/1507.03642>

Optimal minimax strategy in a dice game (2009)

Completo
MORDECKI, E.

Medio de divulgación: Internet
<https://arxiv.org/abs/0912.5518>

Numerical approximation of Backward Stochastic Differential Equations with Jumps (2007)

Completo
MORDECKI, E. , Antoine Lejay , Soledad Torres

Medio de divulgación: Internet
<https://hal.archives-ouvertes.fr/inria-00357992>

Counting Knight's Tours through the Randomized Warnsdorff Rule (2006)

Completo
MORDECKI, E. , CANCELA, HÉCTOR

Medio de divulgación: Internet
<https://arxiv.org/abs/math/0609009>

On the number of open knight's tours (2001)

Completo
MORDECKI, E.

Uruguay
Medio de divulgación: Internet

<http://premat.fing.edu.uy/2001.htm>

Optimal stopping, ruin probabilities and prophet inequalities for Levy processes (2000)

Completo
MORDECKI, E.

Uruguay
Medio de divulgación: Internet
<http://premat.fing.edu.uy/papers/2000/039.ps>

Elementary proofs on optimal stopping (2000)

Completo
MORDECKI, E.

Uruguay
Medio de divulgación: Internet
<http://premat.fing.edu.uy/papers/2001/cacha1.ps>

PUBLICACIÓN DE TRABAJOS PRESENTADOS EN EVENTOS

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

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

Evento: Internacional
Descripción: 10th International Conference, QEST 2013
Ciudad: Buenos Aires
Año del evento: 2013
Anales/Proceedings: Lectures Notes in Computer Sciences
Volumen: 8054
Pagina inicial: 139
Pagina final: 154
Publicación arbitrada
Editorial: Springer
Ciudad: Nueva York
Palabras clave: Limites Fluidos
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Computación e Información / Ciencias de la Computación / Limites Fluidos
Medio de divulgación: Papel
http://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-642-40196-1_10

Fluid Limits Applied to Peer to Peer Network Analysis (2011)

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

Evento: Internacional
Descripción: Quantitative Evaluation of Systems (VIII QEST), 2011
Ciudad: Aachen
Año del evento: 2011
Anales/Proceedings: 2011 Eighth International Conference on the Quantitative Evaluation of Systems
Pagina inicial: 13
Pagina final: 20
Editorial: IEEE Computer Society
Palabras clave: Fluid limits
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Telecomunicaciones
Medio de divulgación: Papel
<http://ieeexplore.ieee.org/stamp/stamp.jsp?tp=&arnumber=6042025&isnumber=6041591>

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

Completo

FAJARDO, J. , MORDECKI, E.

Evento: Internacional

Descripción: Second Bachelier Colloquium on Stochastic Calculus and Finance

Ciudad: Metabief

Año del evento: 2006

Anales/Proceedings: From Stochastic Calculus to Mathematical Finance: The Shiryaev Festschrift

Página inicial: 249

Página final: 256

ISSN/ISBN: 3540307826

Publicación arbitrada

Editorial: Springer

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Medio de divulgación: Papel

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

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

Ruin Probabilities and Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps (1997)

Completo

MORDECKI, E.

Evento: Internacional

Descripción: Fourth Congress Dr A. Monteiro

Ciudad: Bahía Blanca

Año del evento: 1997

Anales/Proceedings: Proceedings of the Fourth Congress Dr A. Monteiro

Página inicial: 39

Página final: 48

Publicación arbitrada

Editorial: Univ. Nac. del Sur

Ciudad: Bahía Blanca

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Medio de divulgación: Papel

Strong convergence of statistical experiments and Hellinger Processes. (1996)

Completo

MORDECKI, E.

Evento: Internacional

Descripción: Frontiers in Pure and Applied Probability II. 4th Finish-Russian Symposium on Probability and Mathematical Statistics

Ciudad: Moscow

Año del evento: 1996

Anales/Proceedings: Proceedings of the 4th Finish-Russian Symposium on Probability and Mathematical Statistics

Página inicial: 139

Página final: 152

Publicación arbitrada

Editorial: TVP Science Publishers

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Medio de divulgación: Papel

TEXTOS EN PERIÓDICOS O REVISTAS

¿Cuánto dura la ola celeste? (2016)

Lento v: 45, 17, 21

Revista

MORDECKI, E. , SOSA ANDRES

ISSN/ISBN: 2301-0584

Medio de divulgación: Otros

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

Mario W: primer decano de la Facultad de Ciencias (2015)

la diaria
Periodicos
MORDECKI, E.

Medio de divulgación: Papel
Fecha de publicación: 09/10/2015
Lugar de publicación: Montevideo

Producción técnica

Otras Producciones

CURSOS DE CORTA DURACIÓN DICTADOS

Dos charlas sobre procesos estocásticos (Movimiento Browniano y fórmula de Itô) (2017)

MORDECKI, E.
Especialización
País: Argentina
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Duración: 1 semanas
Lugar: UNL
Ciudad: Santa Fé
Institución Promotora/Financiadora: Universidad Nacional del Litoral (UNL) Santa Fé, Argentina.

Levy models in Finance (2010)

MORDECKI, E.
Especialización
País: México
Idioma: Inglés
Medio divulgación: Internet
Web: <http://www.cimat.mx/Eventos/ipeapye09/>
Tipo de participación: Docente
Unidad: Centro de Investigaciones Matematicas (CIMAT)
Duración: 1 semanas
Lugar: CIMAT
Ciudad: Guanajuato
Institución Promotora/Financiadora: National Science Foundation (USA)
Palabras clave: Levy Processes Option Pricing
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Probabilidad (2004)

MORDECKI, E.
Especialización
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Institución Promotora/Financiadora: MEC
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones
Información adicional: Curso de Actualización disciplinar en Probabilidad, dirigido a docentes de Enseñanza Secundaria, en el marco de la Transformación de la Educación Media Superior

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

MORDECKI, E.

Especialización
País: Chile
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Lugar: I Escuela de Invierno de Análisis estocástico y Aplicaciones
Ciudad: Valparaíso
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial (2000)

MORDECKI, E.
Especialización
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Ciudad: Santiago
Institución Promotora/Financiadora: Universidad Tecnológica Metropolitana
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /
Información adicional: Jornadas de trabajo en Probabilidades

Modelos matemáticos en finanzas: Valuación de opciones. (1998)

MORDECKI, E.
Extensión extracurricular
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Ciudad: Montevideo
Institución Promotora/Financiadora: UPAE, Facultad de Ciencias Económicas y Administración
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Modelos Estocásticos en Finanzas. (1996)

MORDECKI, E.
Especialización
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Lugar: Sociedad Uruguaya de Matemática y Estadística
Ciudad: Montevideo
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /
Información adicional: Curso en la Primera Escuela Uruguaya de Matemática

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

MORDECKI, E.
Extensión extracurricular
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Ciudad: Montevideo
Institución Promotora/Financiadora: UDELAR
Áreas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

ORGANIZACIÓN DE EVENTOS

Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística (2019)

MORDECKI, E.
Congreso
Sub Tipo: Organización
Lugar: México, México

Idioma: Español
Duración: 1 semanas
Evento itinerante: SI
Información adicional: Integrante del Comité Científico

Seminario Mathamsud 2016: Mathematics and Statistics of Big Data (2016)

MORDECKI, E.
Congreso
Sub Tipo: Otra
Lugar: Uruguay ,ANII Montevideo
Idioma: Español
Web: <http://www.sticmathamsud.org/wp-content/uploads/2016/12/Programa-Seminario-MATH-Montevideo-2016.pdf>
Duración: 1 semanas
Institución Promotora/Financiadora: Agencia Nacional de Investigación e Innovación (ANII)

Optimal stopping and applications (2014)

MORDECKI, E. , Paavo Salminen
Otro
Sub Tipo: Otra
Lugar: Argentina ,Universidad de Buenos Aires Buenos Aires
Idioma: Inglés
Duración: 1 semanas
Evento itinerante: SI
Institución Promotora/Financiadora: Conference on Stochastic Processes and their Applications
Información adicional: Se trata de una sesión temática en un congreso internacional

Wschebor Workshop (2013)

MORDECKI, E.
Congreso
Sub Tipo: Organización
Lugar: Uruguay ,Hotel Alcion Solís
Idioma: Español
Duración: 1 semanas
Institución Promotora/Financiadora: Universidad de la República

7th Regional Meeting on Probability and Mathematical Statistics (2010)

MORDECKI, E.
Congreso
Sub Tipo: Organización
Lugar: Argentina ,Santa Fe
Idioma: Español
Web: <http://www.erpem2010.santafe-conicet.gov.ar/>
Duración: 1 semanas
Institución Promotora/Financiadora: Instituto de Matemática Aplicada del Litoral. Santa Fe, Argentina
Palabras clave: Estadística Probabilidad
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística y Probabilidad
Información adicional: Integrante del Comité Científico

XIV Escuela Latinoamericana de Matemática (ELAM) (2005)

MORDECKI, E.
Otro
Lugar: Uruguay
Idioma: Español
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones
Información adicional: Miembro del Comité Local Organizador

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

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

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

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática (2004)

MORDECKI, E.

Congreso

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Presidente del Comité Local Organizador

Cálculo estocástico y estadística para finanzas en el IX CLAPEM (2004)

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Organizador de la Sesión Especial

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

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

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

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

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

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos Estocásticos y aplicaciones

Información adicional: Integrante del Comité Local Organizador

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

MORDECKI, E.

Congreso

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Información adicional: Integrante del Comité académico

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

MORDECKI, E.

Concierto

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Información adicional: Presidente de la Sección II

Seminario de Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática (1999)

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Coloquio de Matemática (1995)

MORDECKI, E.

Otro

Lugar: Uruguay

Idioma: Español

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad /

Evaluaciones

EVALUACIÓN DE PROYECTOS

EVALUACIÓN INDEPENDIENTE DE PROYECTOS

Mathamsud (2011 / 2011)

Paraguay

Mathamsud

Cantidad: Menos de 5

Delegado de Uruguay en el Comité de Matemática de Mathamsud

Mathamsud (2010 / 2010)

Argentina

Mathamsud

Cantidad: De 5 a 20

Delegado de Uruguay en el comité de matemática del proyecto Mathamsud

Fondo Clemente Estable (2006 / 2006)

Uruguay

Fondo Clemente Estable

Cantidad: De 5 a 20

Comision Sectorial de Enseñanza - UdelaR (2000 / 2000)

Uruguay

Comision Sectorial de Enseñanza - UdelaR

Cantidad: Menos de 5

Comision Sectorial de Investigacion Cientifica CSIC - UdelaR (1999 / 1999)

Uruguay

Comision Sectorial de Investigacion Cientifica CSIC - UdelaR

Cantidad: Menos de 5

EVALUACIÓN DE PUBLICACIONES

COMITÉ EDITORIAL

Brazilian Journal of Probability and Statistics (2012 / 2019)

Tipo de publicación: Anales

Cantidad: De 5 a 20

Editor Asociado

EVALUACIÓN DE CONVOCATORIAS CONCURSABLES

Sistema Nacional de Becas (2011 / 2011)

Uruguay

Cantidad: Menos de 5

ANII

Formación de RRHH

TUTORÍAS CONCLUIDAS

POSGRADO

Modelos probabilísticos en telecomunicaciones. (2019)

Tesis de doctorado

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

Uruguay

Nombre del orientado: Laura Aspirot

País/Idioma: Uruguay, Español

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Telecomunicaciones

Modelos estocásticos en tasas de interés y aplicaciones en la deuda soberana en Uruguay (2018)

Tesis de doctorado

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

Uruguay

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Andres Sosa

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Matematica Financiera Procesos Estocasticos

Areas de conocimiento:

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

Modelacion matematica en Musica (2018)

Tesis de maestria

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería / Maestría

de Ingeniería Matemática , Uruguay

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Verónica Rumbo

País/Idioma: Uruguay, Español

Modelos asimetricos de Levy en Finanzas. (2016)

Tesis de doctorado

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

Programa: Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Federico De Olivera

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Matematica Financiera Procesos Estocasticos

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

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

Opciones Financieras sobre bonos: una aplicacion para el mercado uruguayo (2015)

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Guillermo Magnou

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Modelos de renta fija

Areas de conocimiento:

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

Dinamica espacio-temporal de los linajes de DENV-2 genotipo asiatico-americano en America (2014)

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Bioinformática (UDELAR-PEDECIBA)

Tipo de orientación: Asesor/Orientador

Nombre del orientado: Diana Mir

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Genomica

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Otros Tópicos Biológicos / Bioinformatica

Cambio Climático y su efecto en la biodiversidad (2013)

Tesis de doctorado

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

Programa: Doctorado en Ciencias Biológicas (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Leonardo Ortega

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Estadística

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias Biológicas / Conservación de la Biodiversidad

Formula de Rice: extensiones y aplicaciones (2013)

Tesis de doctorado

Sector Educación Superior/Público / / , Uruguay

Programa: Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Federico Dalmao

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Fórmula de Rice

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Probabilidad Discreta

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

Tesis de doctorado

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

Programa: Doctorado en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Fabian Crocce

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Parada óptima

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Óptima

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

Tesis de maestría

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

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Nombre del orientado: Leonardo Moreno

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Valores extremos

Áreas de conocimiento:

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

Transformadas Generalizadas de Esscher en la calibración de modelos para precios de opciones (2011)

Tesis de maestría

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

Programa: Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

Web: www.cmat.edu.uy

Palabras Clave: Matemática Financiera

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

Valuación de opciones en mercados de Levy Con Enfoque en Riesgo Cambiario Crediticio en el Uruguay (2011)

Tesis de maestría

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

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Nombre del orientado: Andres Sosa

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Matemática Financiera

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

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

Tesis de maestría

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

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Nombre del orientado: Federico de Oliveira

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Matematica Financiera Procesos Estocasticos

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Análisis Numérico - Procesos Estocásticos

Estimacion de probabilidades de default en un grupo de bancos mediante copulas (2010)

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Nombre del orientado: Gabriel Illanes

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Estadística

Areas de conocimiento:

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

Juegos Competitivos Markovianos (2009)

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Fabián Crocce

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

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

Flocking Jerárquico con conectividad aleatoria (2008)

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Federico Dalmao

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Control

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Pura / Sistemas Complejos

Opciones rusas para una difusión con saltos (2000) Trabajo relevante

Tesis de maestria

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

Programa: Maestría en Matemática (UDELAR-PEDECIBA)

Nombre del orientado: Walter Moreira

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

GRADO

Parada óptima en procesos de Markov (2017)

Tesis/Monografía de grado

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Centro de Matemática , Uruguay

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Facundo Oliú

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

Modelación estocástica en música (2017)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Centro de Matemática , Uruguay
Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad
Nombre del orientado: Verónica Rumbo
País/Idioma: Uruguay, Español

Estrategias óptimas en juegos estocásticos transitorios (2010)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería - UDeLaR , Uruguay
Programa: Ingeniería en Computación
Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad
Nombre del orientado: Fabian Crocce
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Uruguay, Español
Palabras Clave: Teoría de Juegos
Áreas de conocimiento:
Ingeniería y Tecnología / Ingeniería Eléctrica, Ingeniería Electrónica e Ingeniería de la Información / Ingeniería de Sistemas y Comunicaciones / Teoría de Juegos

La fórmula de Black Scholes (2008)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR , Uruguay
Programa: Licenciatura en Matemática
Nombre del orientado: Andres Sosa Rodriguez
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Uruguay, Español
Palabras Clave: Matematica Financiera Calculo estocastico
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Modelación de precios de petróleo mediante series condicionalmente heteroscedásticas (2008)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Leticia Marziotte
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Uruguay, Español
Palabras Clave: Series temporales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Modelación de precios de petróleo mediante series condicionalmente heteroscedásticas (2008)

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración - UDeLaR , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Guillermo Magnou
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Uruguay, Español
Palabras Clave: Series temporales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Finanzas

Procesos de Markov controlados: la aplicación a un juego de dados (2007)

Tesis/Monografía de grado

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

Programa: Licenciatura en Matemática

Nombre del orientado: Fabián Croce

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

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

Tesis/Monografía de grado

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

Programa: Licenciatura en Estadística

Nombre del orientado: Federico Olivera

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

Palabras Clave: Climatología

Areas de conocimiento:

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

Parada óptima en procesos estocásticos (2003)

Tesis/Monografía de grado

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

Programa: Licenciatura en Matemática

Nombre del orientado: Federico Dalmao

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

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

Tesis/Monografía de grado

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

Programa: Licenciatura en Matemática

Nombre del orientado: Eduardo Cuitiño

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Areas de conocimiento:

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

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

Tesis/Monografía de grado

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

Programa: Licenciatura en Matemática

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

OTRAS

Becario Erasmus- Mundus en Udelar (2017)

Otras tutorías/orientaciones

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias - UDeLaR / Centro de Matemática , Uruguay

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Grzegorz Krzyzanowski
País/Idioma: Uruguay, Español

Binomial Models in Finance (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: Mok Ngai Ngai
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Binomial Models in Finance (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: Lam Chung Kong
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Binomial Models in Finance (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: Sang Tsun Wai Dick
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Option pricing and implied volatility (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: LI Hang
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Option pricing and implied volatility (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: ZHONG Ying
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Option pricing and implied volatility (2010)

Otras tutorías/orientaciones
Sector Extranjero/Internacional/Otros / City University of Hong Kong , Hong Kong
Nombre del orientado: WANG Xiaowen
Medio de divulgación: Papel
País/Idioma: Hong Kong, Inglés
Palabras Clave: Matematica Financiera
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Matematica Financiera

Estadística (1996)

Iniciación a la investigación

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

Nombre del orientado: Marcela Ribas

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Áreas de conocimiento:

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

Becaria del Proyecto Conicyt 325/95

Matemática (1996)

Iniciación a la investigación

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

Nombre del orientado: Juan Cirielli

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Áreas de conocimiento:

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

Becario del Proyecto Conicyt 325/95

Matemática (1996)

Iniciación a la investigación

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

Nombre del orientado: Isabel Cañette

Medio de divulgación: Otros

País/Idioma: Uruguay, Español

Áreas de conocimiento:

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

Becario del Proyecto Conicyt 325/95

TUTORÍAS EN MARCHA

POSGRADO

Parada óptima bilateral en procesos de Lévy (2019)

Tesis de maestría

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

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Facundo Oliú

País/Idioma: Uruguay, Español

Estadística en datos genómicos (2015)

Tesis de doctorado

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

Tipo de orientación: Asesor/Orientador

Nombre del orientado: Gabriel Illanes

Medio de divulgación: Papel

País/Idioma: Uruguay, Español

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

Palabras Clave: Bioinformática

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Bioestadística

Otros datos relevantes

PREMIOS, HONORES Y TÍTULOS

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

(Nacional)
Academia de Ciencias del Uruguay ANCIU

Sistema Nacional de Investigadores - Nivel III (2009)

(Nacional)
Agencia Nacional de Investigación e Innovación

Investigador del Área Matemática PEDECIBA - Primer Nivel (2007)

(Nacional)
PEDECIBA

Mejor trabajo del año (1994)

(Internacional)
Steklov Mathematical Institute - Russian Academy of Sciences

PRESENTACIONES EN EVENTOS

MAD-Stat seminare (2019)

Seminario
An algorithm to solve optimal stopping problems for one-dimensional diffusions.
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Toulouse School of Economics

La Petite-Pierre (2019)

Encuentro
Two-sided optimal stopping for Lévy processes
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: INRIA, Tosca-NGE.

GDT in Probability and Statistics, Nancy, (2019)

Seminario
An algorithm to solve optimal stopping problems for one-dimensional diffusions.
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: IECL, Nancy, France

Groupe de travail en probabilités et statistiques. (2019)

Seminario
Optimal Stopping for diffusions.
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Institut Élie Cartan de Lorraine and CNRS, Nancy

Hugo Steinhaus Center at Wrocław (2019)

Seminario
Optimal Stopping for diffusions with discontinuous coefficients
Polonia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: University of Science and Technology

Seminar at Wrocław University (2019)

Seminario
An algorithm to solve optimal stopping problems for one-dimensional diffusions.
Polonia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Polish Mathematical Society

Seminar at BATH University (2019)

Seminario
Optimal Stopping for diffusions with discontinuous coefficients
Inglaterra
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Bath University

Seminar at Abo Akademi (2019)

Seminario
Simple Stochastic Games: One (small) result and one (big) question
Finlandia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Abo Akademi, Turku

A Symposium on Optimal Stopping (2018)

Congreso
On optimal stopping of multidimensional diffusions
Estados Unidos
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Houston University

Seminario del IMAL (2017)

Seminario
Some recent results in Optimal stopping
Argentina
Tipo de participación: Conferencista invitado

Seminaire IECL (2017)

Seminario
Some recent results in Optimal stopping
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Institut Elie Cartan de Lorraine, Nancy,

Seminare ABO Akademi (2017)

Seminario
Some recent results in Optimal stopping
Finlandia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Abo Akademi, Turku

16th SAET Conference on Current Trends in Economics (2016)

Congreso
Optimal stopping for Levy processes
Brasil
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: IMPA

International Workshop on Applied Probability (2016)

Congreso
Optimal stopping for Levy processes
Canadá
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: University of Toronto

Seminar in Optimal Stopping (2015)

Seminario
Optimal stopping for polynomial rewards
Finlandia
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 8
Nombre de la institución promotora: Abo Akademi

Palabras Clave: Parada óptima

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Parada Optima

In-ternational conference on stochastic analysis and related topics (2014)

Congreso

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

Brasil

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 20

Nombre de la institución promotora: Universidad de Campinas

Palabras Clave: Fórmula de Rice

Areas de conocimiento:

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

2nd Workshop on Probability and Statistical Methods (2014)

Congreso

Risk neutral prices through implied volatility: smile and smirk.

Brasil

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: UFSCar, Sao Carlos/SP

Palabras Clave: Volatilidad implícita

Areas de conocimiento:

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

Wshcebor Workshop (2013)

Congreso

Rice Formula for processes with jumps and applications

Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Universidad de la República

Palabras Clave: Fórmula de Rice

Areas de conocimiento:

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

Advanced Finance and Stochastics Conference (2013)

Congreso

A new method with examples in optimal stopping

Rusia

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Steklov Institute

Areas de conocimiento:

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

Workshop on Stochastic Numerical Methods (2012)

Congreso

Adaptive Weak Approximation of Diffusions with Jumps

Uruguay

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ingeniería. Udelar

Palabras Clave: Metodos numericos

Areas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Ecuaciones diferenciales estocásticas

Aniversario de la Facultad de Ciencias de la Universidad Central de Venezuela (2012)

Seminario

Parada optima de procesos estocásticos

Venezuela

Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Universidad Central de Venezuela
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Procesos estocásticos

Workshop en Matemática Aplicada y Computacional con Aplicaciones a la Ingeniería: WAMCE (2010)

Congreso
Dice: probability, optimal stopping, control and stochastic games
Paraguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Universidad Nacional de Asuncion
Palabras Clave: Juegos estocásticos
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Matemática Aplicada / Control estocástico

Congreso IFUM (2009)

Congreso
Adaptive Weak Approximation of Diffusions with Jumps
Uruguay
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Instituto Franco Uruguayo de Matematica

Festival de Matematica MatBaires (2009)

Otra
Posibilidades y limitaciones de la modelacion matematica
Argentina
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Universidad de Buenos Aires

Xi Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática (2009)

Congreso
Symmetry duality and skewness in Levy markets
Venezuela
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Sociedad Latinoamericana de Probabilidad y Estadística Matemática
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Matemática Financiera

XI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática (2009)

Congreso
Is a Brownian motion Skew?
Venezuela
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Sociedad Latinoamericana de Probabilidad y Estadística Matemática
Areas de conocimiento:
Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística de procesos aleatorios

Workshop on mathematical finance (2008)

Taller
Workshop on mathematical Finance
Japón
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Center for finance and insurance. Osaka University.

Workshop on Stochastic Modelling (2008)

Taller
Workshop on Stochastic Modelling

Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Universidad de San Pablo

Se realizó en el campus de Riberáo Preto

Foundations of Computational Mathematics 2008 (2008)

Congreso

Adaptive weak approximation of diffusion with jumps

Hong Kong

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: City University of Hong Kong

Palabras Clave: Metodos numericos

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Ciencias de la Computación e Información / Ciencias de la

Computación / Análisis numerico en ecuaciones diferenciales estocasticas

Cuarto Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática (2007)

Encuentro

Cuarto Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Argentina

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Palabras Clave: Procesos Estocásticos

Áreas de conocimiento:

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

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

XXX Congreso Nacional de Matemática Aplicada e Computacional (2007)

Congreso

XXX Congresso Nacional de Matemática Aplicada e Computacional

Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Sociedad de Matemática Aplicada y Computacional

Optimal Stopping of Hunt and Lévy Processes. XXX Congresso Nacional de Matemática Aplicada e

Computacional, Conferencia en el Minisimposio: Modelagem matemática em finanças, 3 al 6 de

setiembre de 2007, Florianópolis, Brasil

Mathematics and Finance: from Theory to Practice (2006)

Congreso

Mathematics and Finance: from Theory to Practice

Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: IMPA

Palabras Clave: Matemática Financiera

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Modelos estocásticos en

Finanzas

Título de la conferencia: Duality and Symmetry in Levy Markets

Tercer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática (2006)

Encuentro

Tercer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Argentina

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Título de la Conferencia: Symmetry and Duality in Levy Markets

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

Congreso
Conference on Stochastics in Science. In Honor of Ole E.Barndorff-Nielsen
México
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Centro de Investigaciones Matematicas
Titulo: Ruin Probability and Optimal Stopping for Levy Processes , March 20-24, 2006, Guanajuato, Mexico.

Symposium on Optimal Stopping with Applications (2006)

Simposio
Symposium on Optimal Stopping with Applications
Gran Bretaña
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: University of Manchester
Titulo: Optimal Stopping and maxima for Levy Processes, 22-27 January 2006.

Winter School of the Visitors Program (2005)

Taller
Winter School of the Finnish Visitors Program
Finlandia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Finnish Minister of Education
Titulo: Optimal Stopping and Ruin probabilities for Levy processes. Mekrijarvi Research Station, 14-16.3.2005.

Seminarie Bachelier (2005)

Seminario
Seminarie Bachelier
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Instituto Henri Poincare
Titulo: Ruin probabilities for Lévy processes: exact solutions, Paris, 4/9/2005

Seminar on Stochastic Differential Equations (2005)

Seminario
Seminar on Stochastic Differential Equations
Finlandia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Universidad de Jyvaskyla
Titulo: Perpetual American options for Lévy processes. 28/04/2005

Conference at the Finnish Mathematical Society (2005)

Seminario
Conference at the Finnish Mathematical Society
Finlandia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: University of Helsinki
Titulo: Exact Ruin Probabilities for a class of Levy processes. Monday 11 April 2005.

Segundo Congreso Latinoamericano de Matematicos, (2004)

Congreso
Segundo Congreso Latinoamericano de Matematicos (UMALCA),
México
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Union Matematica de America Latina y el Caribe

20 al 26 de Junio de 2004. Conferencia en la sesion de Probabilidad y Estadistica. Titulo: Find the Martingale, Cancun, Mexico.

IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática (2004)

Congreso

IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática

Uruguay

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Regional Latinoamericana de la Sociedad Bernoulli

22 al 26 de marzo de 2004, Punta del Este, Uruguay. Conferencia en la sesion especial: Procesos de

Levy. Titulo: Exact distribution of the maximum of a Levy process

Seminario del Instituto de Matemática Aplicada del Litoral (IMAL) (2004)

Seminario

Seminario del Instituto de Matemática Aplicada del Litoral (IMAL)

Argentina

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: CONICET Universidad Nacional del Litoral

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

Seminario de Probabilidad IME Universidad de San Pablo (2004)

Seminario

Seminario de Probabilidad IME Universidad de San Pablo

Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Instituto de Matemática y Estadística. Universidad de San Pablo

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

Primer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática (2004)

Encuentro

Primer Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

Argentina

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Centro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática

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

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA (2003)

Congreso

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA

Chile

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 40

Nombre de la institución promotora: Universidad Católica del Norte

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

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA (2003)

Congreso

XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA

Chile

Tipo de participación: Conferencista invitado

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Universidad Católica del Norte

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

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

Congreso
Conference dedicated to the 90th anniversary of B. V. Gnedenko
Ucrania
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: National Taras Shevchenko University of Kiev
Titulo: Optimal Stopping and Ruin probabilities for Levy processes. June 3-7, 2002, Kiev.

Jornadas de Investigación de la UTEM (2000)

Congreso
Bounds on option prices for semimartingales through statistical experiments
Chile
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Universidad Tecnologica Metropolitana Santiago

Seminario Laboratoire de Statistique et Probabilites (2000)

Seminario
Seminario Laboratoire de Statistique et Probabilites
Francia
Tipo de participación: Conferencista invitado
Carga horaria: 40
Nombre de la institución promotora: Universidad Paul Sabatier
Arret optimal et opciones perpetuelles pour les processus de Levy, 6/2000. Toulouse.

Seminario UFRGS (1999)

Seminario
Pricing pepetual american options for processes with jumps
Brasil
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Univer- sidad Federal de Rio Grande do Sul, Porto Alegre

VII CLAPEM (1998)

Congreso
Parada optima de procesos y aplicaciones a finanzas
Argentina
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Sociedad Bernoulli, Sección Latinoamericana

Seminario de la UTDT (1998)

Seminario
Parada optima, probabilidades de ruina y desigualdades del profeta para procesos de Levy
Argentina
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Universidad Torcuato Di Tella

Seminario de la UAM (1997)

Seminario
Valuacion de opciones americanas perpetuas para activos con saltos
España
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Universidad Autonoma de Madrid

Seminario del IMPA (1996)

Seminario
Parada optima para una difusion con saltos
Brasil
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: IMPA, Rio de Janeiro

XX Coloquio Brasileiro de Matematica (1995)

Congreso
Pricing options under discontinuous returns
Brasil

Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: IMPA, Rio de Janeiro

Seminario del DIM (1995)

Seminario
Parada ?optima de procesos y aplicaciones
Chile
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Departamento de Ingenieria Matematica, Universidad de Chile

Modelos estocasticos en finanzas: valoracion de opciones (1995)

Seminario
Modelos estocasticos en finanzas: valoracion de opciones
España
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: Universidad Autonoma de Madrid

XIX Coloquio Brasileiro de Matematica (1993)

Congreso
Integral option, An application of optimal stopping rules
Brasil
Tipo de participación: Conferencista invitado
Nombre de la institución promotora: IMPA, Rio de Janeiro

CONSTRUCCIÓN INSTITUCIONAL

Director del Centro de Matematica de la Facultad de Ciencias (Agosto 2000-Agosto 2001, Agosto 2006-Agosto 2007, Agosto 2014-Agosto 2015) Coordinador de la Subcomision Academica de Posgrado (SCAPA) de Ingenieria Matematica, Facultad de Ingenieria (agosto de 2008 - marzo 2010) Presidente de la Asamblea del Claustro de la Facultad de Ciencias (2002-2004) Coordinador por Uruguay del Eje Probabilidad y Estadística del Instituto Franco-Uruguayo de Matemática (IFUM, 2012-2018). Coordinador de del PEDECIBA Matemática.

Información adicional

JURADO/INTEGRANTE DE COMISIONES EVALUADORAS DE TRABAJOS ACADÉMICOS: más de 30 entre doctorados, maestrías, trabajos de grado, en Matemática, Estadística, Ingeniería, Informática Economía, en Uruguay, Argentina, Brasil, Paraguay, Arabia Saudita, Hong Kong. Arbitro para publicación de aproximadamente 100 artículos en 45 publicaciones internacionales en el área.

Indicadores de producción

PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA	66
Artículos publicados en revistas científicas	45
Completo	45
Artículos aceptados para publicación en revistas científicas	1
Completo	1
Trabajos en eventos	5
Libros y Capítulos	6
Libro publicado	4
Capítulos de libro publicado	2
Textos en periódicos	2
Periodicos	1
Revistas	1

Documentos de trabajo	7
Completo	7
Otros tipos	25
PRODUCCIÓN TÉCNICA	25
EVALUACIONES	7
Evaluación de proyectos	5
Evaluación de publicaciones	1
Evaluación de convocatorias concursables	1
FORMACIÓN RRHH	40
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas	38
Tesis de maestría	11
Tesis/Monografía de grado	11
Iniciación a la investigación	3
Tesis de doctorado	6
Otras tutorías/orientaciones	7
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones en marcha	2
Tesis de doctorado	1
Tesis de maestría	1