

CURRICULUM VITAE

Ernesto Mordecki Pupko

Agosto de 2006

1 Formación académica	1
2 Actividad de Enseñanza	2
3 Actividad de Investigación	5
4 Otras Actividades Académicas	10
5 Actividad Profesional	14
6 Actividades de Extensión	15
7 Otros méritos y antecedentes	16

Datos personales

Fecha de nacimiento: 6 de octubre de 1962.

Estado civil: casado, dos hijos.

Dirección postal: Centro de Matemática. Facultad de Ciencias. Iguá 4225. CP 11400.
Montevideo, Uruguay. Tel: (598-2) 525 25 22. Fax: (598-2) 522 06 53.

Dirección electrónica: mordecki@cmat.edu.uy

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

Idiomas Inglés, Ruso.

1 Formación académica

1994. Ph.D in Physics and Mathematics. Steklov Mathematical Institute. Moscú, Rusia. Tutor: Albert Nicolaievich Shiryaev. Tesis: Convergencia de experimentos estadísticos y procesos de Hellinger.

1990. Magister en Matemática. Universidad de la República. PEDECIBA. Montevideo, Uruguay. Tutor: Enrique Mario Cabaña. Tesis: Teorema Central del Límite para Martingalas Fuertes Biparamétricas.

1989. Licenciado en Matemática. Facultad de Ciencias. Universidad de la República. Montevideo, Uruguay. Tutor: Ricardo Fraiman.

1985. Bachiller en Ciencias Básicas de Ingeniería. Facultad de Ingeniería. Universidad de la República. Montevideo, Uruguay.

2 Actividad de Enseñanza

Cargos docentes

- Facultad de Ciencias. Centro de Matemática.
 - Desde el 1/1/1998 Profesor Agregado (efectivo) en Régimen de Dedicación Total universitaria.
 - 1990-1997. Profesor Adjunto (efectivo).
 - 1987-1989. Ayudante interino.
- Facultad de Ciencias Económicas y Administración.
 - 1997. Profesor Titular (efectivo) de Matemática I.
- Facultad de Ingeniería, Instituto de Matemática y Estadística “Rafael Laguardia”.
 - 1990-1996. Profesor Adjunto (efectivo).
 - 1986-1990. Asistente interino.
 - 1982-1986. Ayudante interino.
- Fecha de Ingreso a la Universidad (en la FING): 26/4/1982.

Libros publicados

- V. Petrov, E. Mordecki. Teoría de Probabilidades. Editorial URSS: Moscú, Rusia (2002), 287 págs.

Dirección de Estudiantes

- **Maestría en Matemática:**
 - Walter Moreira. Tesis: Opciones Rusas para una difusión con saltos (2000),
 - Juan Cirielli (en curso).
- **Dirección de Monografías en Matemática:**
 - Oscar André Gutierrez (en curso)
 - Federico Dalmao. Parada óptima en procesos estocásticos (2/2006)
 - Freddy Rabín. Ley fuerte de los grandes números (en curso).
 - Eduardo Cuitiño. El modelo de Cramér-Lundberg para el problema de la ruina y generalizaciones para distribuciones con colas pesadas (6/2001)
 - Juan Cirielli. Valuación de opciones europeas y americanas en el modelo binomial. Arbitrajes y ejemplos (8/11/1999).
- **Dirección de Pasantías de la Licenciatura en Estadística:**
 - Federico de Olivera: “El Niño: Predicción del fenómeno” (2003).
- **Dirección de becarios de Proyectos:**

- Fabián Croce, Federico Dalmao, Federico De Olivera. Becarios del Proyecto CSIC (2005)
 - Federico Dalmao. Becario de Proyecto CSIC (2003)
 - Isabel Cañette, Juan Cirielli, Marcela Ribas. Becarios del Proyecto Conicyt 325/95.
- **Dirección de trabajos de pasaje de curso** (Licenciatura y Magister en Matemática) Laura Aspirot, Hugo Carrasco, Eduardo Cuitiño, Celina Gutierrez, Cesar Niche, Pablo Spallanzani

Dictado de cursos de grado

Análisis Matemático I (1988, anual, teórico, FING), Álgebra Lineal (1990, anual, teórico, FING), Matemática para Biología (1990, primer semestre, teórico, FHC), Cálculo diferencial e integral II (1990, segundo semestre, teórico, FHC), Matemática I (1995, primer semestre, teórico, FC), Álgebra lineal I (1995, primer semestre, teórico, FING), Estadística de procesos (1995, segundo semestre, teórico), Análisis II (1995, segundo semestre, teórico, responsable, FING), Análisis I (1996, teórico, anual, FING), Inferencia III (1996, segundo semestre, teórico), Probabilidad II (1997, primer semestre, teórico), Inferencia III (1997, segundo semestre, teórico), Matemática I (1997, teórico, anual, FCEA), Cálculo diferencial e integral I (1998, primer semestre, teórico), Introducción al Análisis Real (1998, segundo semestre, teórico), Introducción a la Probabilidad y Estadística (1999, primer semestre, teórico), Álgebra Lineal II (1999, segundo semestre, teórico), Probabilidad II (2000, primer semestre, teórico), Matemática II (2000, segundo semestre, teórico), Introducción a la probabilidad y estadística (2001, primer semestre, teórico), Cálculo Diferencial e Integral I (2002, primer semestre, teórico, coordinación), Cálculo Diferencial e Integral II (2002, segundo semestre, teórico), Cálculo Diferencial e Integral I (2003, primer semestre, teórico, coordinación), Cálculo Diferencial e Integral II (2003, segundo semestre teórico), Introducción a la Probabilidad y Estadística (2004, primer semestre, teórico), Cálculo Diferencial e Integral II (2004, segundo semestre teórico). Introducción a la Probabilidad y Estadística (2006, primer semestre, teórico) Cálculo Diferencial e Integral II (2006, segundo semestre teórico).

Dictado de cursos de posgrado

- 1996.** Introducción al Cálculo Estocástico y sus Aplicaciones. Posgrado en Matemática.
- 1996.** Procesos Estocásticos. Programa de Posgrado en Ingeniería.
- 1999.** Semigrupos de operadores y procesos de Markov, (junto con Fernando Peláez). Posgrado en Matemática.
- 2001.** Introducción a los procesos estocásticos (segundo semestre). Posgrado en Matemática
- 2004.** Cálculo Estocástico (segundo semestre). Posgrado en Matemática
- 2006.** Métodos numéricos en ecuaciones diferenciales estocásticas (Curso dictado por Raúl Tempone y Ernesto Mordecki - CMAT - IMERL)
- 2006.** Statistical Methods and Calibration in Finance and Actuarial Science. Curso del programa “Master in Finance and Actuarial Sciences”, City University of Hong Kong (2006), Hong Kong, SAR, China.

2006. Cálculo Estocástico y aplicaciones (segundo semestre). Posgrado en Matemática

Organización de cursos de posgrado

1999. “Statistics of Continuous time stochastic processes”, a cargo del Profesor Alexander Gushchin del Instituto Steklov de la Academia de Ciencias de Rusia.

2000. “Limit theorems of Probability Theory” a cargo del Prof. V. Petrov de la Universidad de San Petersburgo, Rusia.

2002. “Limit theorems of Probability Theory II” a cargo del Prof. V. Petrov de la Universidad de San Petersburgo, Rusia.

Organización de Seminarios y Coloquios

- Responsable del Coloquio de Matemática (1995)
- Coordinador del Seminario de Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática (1999)
- Coordinador del Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática Primer semestre de 2003: Cadenas de Markov
- Coordinador del Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática Segundo semestre de 2003: Complejidad de Kolmogorov.
- Coordinador del Seminario de Estudio en Probabilidad y Estadística del Centro de Matemática Primer semestre de 2004: Procesos de Poisson y de Wiener.
- Co-coordinador del Seminario de Probabilidad y Estadística de las Facultades de Ciencias Económicas, Ingeniería y Ciencias. Segundo semestre de 2004
- Coordinador del “Seminario de Problemas de Probabilidad”, segundo semestre de 2005.

Notas de Cursos

- Cálculo diferencial e integral en varias variables Notas del curso de Cálculo Diferencial e Integral II Licenciatura en Matemática (2003-2004).
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/2calculoteorico/>
- Distribución del máximo de un proceso de Lévy y aplicaciones en finanzas y matemática actuarial. Notas del Curso de la I Escuela de Invierno de Análisis Estocástico y Aplicaciones 28 de julio al 1 de agosto de 2003, Valparaíso - Chile
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/valparaiso/>
- Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial. Curso en la Universidad Tecnológica Metropolitana. Santiago, Chile. Diciembre 2000.
- Lévy process in finance and insurance. Short course in the “Second Brazilian Conference on Statistical Modelling in Insurance and Finance”. Maresias, August 28 - September 3, 2005, Brazil, 63 pp.
- Statistical Methods and Calibration in Finance and Actuarial Science. Curso del programa “Master in Finance and Actuarial Sciences”, City University of Hong Kong (2006), Hong Kong, SAR, China. <http://www.cmat.edu.uy/mordecki/hk/>

Creación de Sitios en Internet

- Cálculo Diferencial e Integral II. Segundo semestre de 2003.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/2calculo/>
- Cálculo Diferencial e Integral I. Primer semestre de 2003.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/1calculo/>
- Cálculo Diferencial e Integral II. Segundo semestre de 2002.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/calculo2/>
- Cálculo Diferencial e Integral I. Primer semestre de 2002.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/calculo1/>
- Introducción a la Probabilidad y Estadística, 2001.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/probabilidad01/>

3 Actividad de Investigación

Artículos científicos publicados

1. Mordecki E. Convergence of Binary Statistical Experiments and Hellinger Processes. *Russian Math. Surveys*, (1992) **47** pp. 223-224.
2. Mordecki E. Necessary Conditions for Stable Convergence of Semimartingales. *Russian Math. Surveys*, (1993) **48** pp. 193-194.
3. Mordecki E. Asymptotic mixed normality and Hellinger Processes. *Stochastics and Stochastic Reports*, (1994) **48 (3-4)** pp 129-143.
4. Kramkov D.O. and Mordecki E. Integral Option. *Theory of Probability and Its Applications*, (1994) **39 (1)** pp 201-210.
5. Mordecki E. Strong convergence of statistical experiments and Hellinger Processes. *Frontiers in Pure and Applied Probability II (Proceedings of the 4th Finish-Russian Symposium on Probability and Mathematical Statistics)*. Ed. by A.N. Shiryaev et al, Moscow, TVP Science Publishers (1996) pp. 139-152.
6. Mordecki E. Optimal Stopping Rules for Compound Poisson Processes. *Publicaciones Matemáticas del Uruguay*, (1997) **7** pp. 55-66.
7. Mordecki E. Ruin Probabilities and Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps. *Proceedings of the Fourth Congress "Dr A. Monteiro"*. (Bahia Blanca, 1997), Univ. Nac. del Sur, Bahia Blanca, Argentina, pp 39-48.
8. Mordecki E. Necessary conditions for stable convergence of semimartingales. *Theory of Probability and Its Applications* (1999) **44, 1** pp 229-232.
9. Mordecki E. Optimal Stopping for a Diffusion with Jumps. *Finance and Stochastics* **3** (1999) pp. 227-238.
10. Kramkov, D.O., Mordecki E. Optimal stopping and Maximal Inequalities for Poisson Processes. *Publicaciones Matemáticas del Uruguay*. (1999) **8** pp. 153-178.

11. Mordecki, E. Moreira, W. Russian options for a diffusion with negative jumps. *Publicaciones Matemáticas del Uruguay*, **9** (2001) 37–52
12. Gushchin A.A., Mordecki E. Bounds of option prices and statistical experiments for semimartingales. *Proceedings of the Steklov Mathematical Institute*, Vol. 237 (2002) 80–122
13. Mordecki, E. Perpetual options for Lévy processes in the Bachelier model. *Proceedings of the Steklov Mathematical Institute*, Vol. 237 (2002) 256–264
14. Mordecki, E. Optimal stopping and perpetual options for Lévy processes. *Finance and Stochastics*, Volume VI (2002), issue 4, 473–493
15. E. Mordecki. The distribution of the maximum of a Lévy processes with positive jumps of phase-type. *Theory of Stochastic Processes*, 8(24), 2002, N3-4, pp. 309–316.
16. Mordecki, E. Ruin probabilities for a Lévy process with mixed exponential negative jumps. *Theory of Probability and its Applications*, **48**, 2003, 188–194.
17. Severov D.N., Mordecki E., Pshennikov V.A. SST anomaly variability in Southwestern Atlantic and El Niño/Southern oscillation *Advances in Space Research* 33 (2004) 343–347.
18. Mordecki E, Wschebor M. Approximation of the occupation measure of Lévy processes. *C. R. Acad. Sci., Paris*, 340 Série I: 605–610 (2005)
19. José Fajardo and Ernesto Mordecki. A note on Pricing, Duality and Symmetry for Two Dimensional Lévy Processes. From Stochastic Calculus to Mathematical Finance. The Shiryaev Festschrift. Eds: Yu. Kabanov, R. Liptser, J. Stoyanov, pp 249 - 256. Springer (2006)
20. José Fajardo and Ernesto Mordecki. Pricing Derivatives on Two-Dimensional Lévy Processes. *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, Vol. 9, No. 2 (2006) 185–197
21. Mordecki E. and Wschebor M. Smoothing the paths and weak approximation of the occupation measure of Lévy processes. *Publicaciones Matemáticas del Uruguay*. Volumen 11, pp 23–40 (2006)
22. José Fajardo and Ernesto Mordecki. Symmetry and Duality in Lévy Markets To Appear in *Quantitative Finance* (2006)

Artículos sometidos a publicación

1. Lewis, A., Mordecki, E. Wiener-Hopf factorization for Lévy processes with negative jumps with rational transforms
2. Optimal Stopping of Hunt and Lévy Processes Ernesto Mordecki and Paavo Salminen April 2006.

Proyectos de investigación

- Responsable del proyecto: “Aprendizaje automático sobre procesos estocásticos” Fondo Clemente Estable (2004)
- Co-responsable del proyecto: “Distribución del máximo de un proceso aleatorio y sus aplicaciones” (2005-2006) I+D CSIC.
- Análisis estocástico, Campos Vectoriales Aleatorios y Aplicaciones. Responsables: Mario Wschebor y Ernesto Mordecki (2003). Proyecto CSIC I+D 2001/115.
- Modelos Estocásticos en Finanzas, CONICYT-BID No. 325/95, 1996-1999 (Responsable científico).
- Estudio de las trayectorias de procesos aleatorios. CONICYT-BID, 1996-1998 (investigador).
- Aproximación del tiempo local; distribución del máximo de procesos estocásticos, Proyecto de Cooperación ECOS U97E02 entre Francia y Uruguay, (investigador).
- Inversión bajo incertidumbre, Fondo Clemente Estable-CONICYT (investigador).

Dictado de cursos en eventos científicos

- Lévy process in finance and insurance. Short course in the “Second Brazilian Conference on Statistical Modelling in Insurance and Finance”. Maresias, August 28 - September 3, 2005, Brazil.
- Distribución del máximo de un proceso de Lévy y aplicaciones en finanzas y matemática actuarial. Primera Escuela de Invierno de Análisis Estocástico y Aplicaciones, Valparaíso, Chile, 28/07/2003 al 1/08/2003.
- Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial. Jornadas de trabajo en Probabilidades. Universidad Tecnológica Metropolitana, Temuco, Chile. 18,19 y 20 de diciembre de 2000.
- Modelos Estocásticos en Finanzas. Primera Escuela Uruguaya de Matemática, Sociedad Uruguaya de Matemática y Estadística (1996).

Dictado de conferencias internacionales

- XIX Coloquio Brasileiro de Matemática, Rio de Janeiro, julio de 1993: Integral option, An application of optimal stopping rules.
- XX Coloquio Brasileiro de Matemática, Rio de Janeiro, Julio de 1995: Pricing options under discontinuous returns.
- “Parada óptima de procesos y aplicaciones”. Departamento de Ingeniería Matemática, Universidad de Chile, Santiago, Noviembre de 1995.
- “Modelos estocásticos en finanzas: valoración de opciones”. Universidad Autónoma de Madrid. Madrid, España (12/1995).
- “Parada óptima para una difusión con saltos”. 27/02/1996. Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro, Brasil.

- Valuación de opciones americanas perpetuas para activos con saltos. Universidad Autónoma de Madrid. Madrid, España (12/1997)
- Parada óptima de procesos y aplicaciones a finanzas. VII Clapem, Setiembre 1998, Córdoba, Argentina.
- Parada óptima, probabilidades de ruina y desigualdades del profeta para procesos de Lévy. Universidad Torcuato di Tella. Buenos Aires, Argentina. 19/11/1998.
- Pricing perpetual american options for processes with jumps. 1/12/1999. Universidad Federal de Rio Grande do Sul, Porto Alegre, Brasil.
- Arret optimal et options perpetuelles pour les processus de Levy, 6/2000. Laboratoire de Statistique et Probabilites. Universite Paul Sabatier, Toulouse, Francia.
- 12/2000. Bounds on option prices for semimartingales through statistical experiments, 12/2000. Universidad Tecnológica Metropolitana Santiago, Chile.
- Optimal Stopping and Ruin probabilities for Lévy processes. “Conference dedicated to the 90th anniversary of B. V. Gnedenko” June 3-7, 2002, Kiev, Ucrania.
- XIII Congreso de Matemática CAPRICORNIO, COMCA 2003. Antofagasta Chile, 5 al 9 de agosto de 2003. Conferencias:
- Dualidad put-call y simetría para procesos de Lévy
- Comparación de experimentos estadísticos generados por procesos de Lévy
- Duality and Derivative Pricing with Lévy Processes. Instituto de Matemática y Estadística. Universidad de San Pablo (29 de enero de 2004)
- IX CLAPEM, 22 al 26 de marzo de 2004, Punta del Este, Uruguay. Conferencia en la sesión especial: Procesos de Lévy. Título: “Exact distribution of the maximum of a Lévy process”
- Segundo Congreso Latinoamericano de Matemáticos (UMALCA), 20 al 26 de Junio de 2004. Conferencia en la sesión de Probabilidad y Estadística. Título: Find the Martingale.
- Problemas de barrera en procesos estocásticos. Instituto de Matemática Aplicada del Litoral (IMAL) CONICET Universidad Nacional del Litoral, Santa Fe, Argentina (24/9/2004)
- Modelos Estocásticos en Finanzas. Conferencia inicial de la sesión Ecuaciones estocásticas y aplicaciones en finanzas del 1er Encuentro Regional de Probabilidad y Estadística Matemática (ERPEN), Buenos Aires, Argentina, 30/09/2004 al 02/10/2004.
- Optimal Stopping and Ruin probabilities for Lévy processes “Winter School of the Visitors Program Mekrijrvi Research Station 14.-16.3.2005”, Finland.
- “Exact Ruin Probabilities for a class of Lévy processes” Conference at the Finnish Mathematical Society. University of Helsinki. Monday 11 April 2005, Helsinki, Finland.
- Perpetual American options for Lévy processes. Seminar on Stochastic Differential Equations, 28/04/2005, Universidad de Jyväskylä, Jyväskylä, Finlandia.

- “Ruin probabilities for Levy processes: exact solutions”, 4/9/2005, Seminario Bachelier, Institute Henri Poincaré, París, Francia.
- “Optimal Stopping and maxima for Lévy Processes” Symposium on Optimal Stopping with Applications, 22-27 January 2006, The University of Manchester,
- Conference on Stochastics in Science. In Honor of Ole E.Barndorff-Nielsen, March 20-24, 2006, Guanajuato, México (Title to be announced).

Dictado de conferencias nacionales

- 10/9/1998. Apuestas y Martingalas. Coloquio de Matemática
- 18/9/2000. Cotas de precios de opciones con semimartingalas a través de experimentos estadísticos. Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 3/4/2000. Parada óptima y opciones perpetuas para procesos de Lévy. Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 2/6/2001. Comparacion de experimentos estadísticos generados por semimartingalas. Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 7/2001. Problemas de ruina y de parada óptima para procesos con saltos. Laboratorio de Probabilidad y Estadística (FING-FCIEN)
- 8/4/2002. Problemas de barrera para el proceso de Wiener con tendencia en tiempo finito Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 24 y 31 de octubre de 2002. Procesos de Lévy y distribución del máximo de un proceso de Lévy con saltos positivos de tipo fase. Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 27/11/2002. Cadenas de Markov con tiempo continuo y distribuciones de tipo fase Seminario de estudio en probabilidad y estadística.
- 19/8/2003 Kolmogorov, Probabilidad, Complejidad algoritmica. Charla conmemorativa del centenario del nacimiento de Andrei N. Kolmogorov (23/4/1903 - 20/10/1987) Coloquio del IMERL.
- 30/9/2003. Aplicaciones en finanzas del teorema de Girsanov para procesos de Lévy multidimensionales. Seminario de Probabilidad y Estadística, FCIEN.
- 7/5/2004. Barreras, máximos y ruinas. Coloquio del Centro de Matemática

Prepublicaciones de la Universidad de la República

- 1999/28. E. Mordecki; Ruin probabilities for Lévy processes with mixed-exponential negative jumps
- 2000/36. E. Mordecki; Optimal stopping and perpetual options for Lévy processes
- 2000/39. E. Mordecki; Optimal stopping, ruin probabilities and prophet inequalities for Lévy processes
- 2000/40. E. Mordecki; Elementary proofs on optimal stopping.
- 2000/41. E. Mordecki; Procesos de Lévy en matemática financiera y actuarial.

- 2001/46. E. Mordecki y W. Moreira; Russian options for a diffusion with negative jumps.
- 2001/57. Mordecki, E.; On the Number of Knight's Tours.
- 2002/59. Gushchin, A.; Mordecki, E.; Bounds on option prices for semimartingale market models.
- 2002/66. Mordecki, E.; The distribution of the maximum of a Lévy process with positive jumps of phase-type.
- 2003/74. Mordecki, E.; Wschebor, M.; Smoothing of paths and weak approximation of the occupation measure of Lévy processes
- 2003/76. Fajardo, J.; Mordecki, E.; Duality and derivative pricing with Lévy processes.
- 2005/82. Lewis, A.; Mordecki, E.; Wiener - Hopf factorization for Lévy processes having negative jumps with rational transforms.
- 2006/89 Mordecki, E.; Salminen, P.; Optimal stopping of Hunt and Lévy processes.

Otros trabajos de investigación

1. Mordecki E. Descomposición de Doob-Meyer para una quasimartingala biparamétrica, (1989) Preprint.
2. Mordecki E. Central Limit Theorem for string-martingales, (1989) Preprint.
3. Accinelli E., Dubra J.M., Mordecki E. A note in the Dynamics in General Equilibrium Theory, (1996) Preprint

4 Otras Actividades Académicas

Organización de eventos científicos

- Presidente de la Sección II de Economía Matemática en el Congreso de la Latin American and Caribbean Economic Association (LACEA) Montevideo 2001
- Integrante del Comité académico del I Congreso Internacional de Matemática Aplicada a la Ingeniería y Enseñanza de la matemática en Ingeniería, 7,8,9 de noviembre de 2001, Facultad de Ingeniería, Universidad de Buenos Aires, Argentina
- Integrante del Comité Local Organizador del "Primer Encuentro Nacional de Jóvenes Matemáticos y Estadísticos - En recuerdo de Gonzalo Pérez Iribarren" (3/9/2003)
- Organizador de la Sesión Especial "Cálculo estocástico y estadística para finanzas" en el IX CLAPEM - 22/26 de Marzo de 2004, Punta del Este, Uruguay.
- Presidente del Comité Local Organizador del IX Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática (CLAPEM - 22/26 de Marzo de 2004, Punta del Este, Uruguay)
- Integrante del Comité Organizador de la XIV Escuela Latinoamericana de Matemática (ELAM), 1 al 9 de diciembre de 2005, Uruguay.

- Coordinador del Panel de “Financial Mathematics” en el “International Congress on the Applications of Mathematics”, organizado por la UMALCA, la EMS y la SIAM, Santiago de Chile, 13-17 Marzo, 2006.

Pasantías en centros de investigación

- Pontificia Universidad Católica de Chile. Santiago, Chile. Enero 1991.
- Departamento de Ingeniería Matemática, Universidad de Chile. Santiago. Diciembre de 1995.
- Universidad Autónoma de Madrid. Madrid, España. Diciembre de 1995
- Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro, Brasil. Febrero, de 1996.
- Universidad Autónoma de Madrid. Madrid, España. Diciembre de 1997.
- Universidad Paul Sabatier, Toulouse, Francia. Laboratorio de Estadística y Probabilidad. Junio de 2000, Setiembre de 2005.
- Instituto de Matemática Steklov, Academia de Ciencias de Rusia. Junio de 2002.
- Instituto de Matemática y Estadística de la Universidad de San Pablo. Enero de 2004.
- Åbo Akademi. Marzo - Junio 2005, Turku, Finlandia, Marzo - Junio 2005.

Participación en eventos científicos

- 2as. Jornadas Nacionales del Seminario de Probabilidad de Chile. Valparaíso. Noviembre de 1986.
- VIII Escuela de Invierno de Probabilidad y Estadística, Santiago, Chile, julio de 1989. Comunicación: Descomposición de Doob-Meyer para una quasimartingala biparamétrica.
- IV Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática, Méjico, setiembre de 1990. Comunicación: Central Limit Theorem for Planar Strong Martingales.
- IV Simposio Soviético-Japones de Probabilidades y Estadística Matemática, Kiev, URSS, agosto de 1991.
- V Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática, San Pablo, 6/1993. Comunicaciones: (a) Asymptotic mixed normality for branching processes. (b) Integral option, an application of optimal stopping rules.
- Simposio Ruso-Finlandés de Probabilidad y Estadística, Moscú, octubre de 1993. Comunicaciones: (a) Asymptotic mixed normality for branching processes. (b) Integral Option, (con D.O. Kramkov). (c) On the pricing of american options, (con A.N. Shiryaev D.O. Kramkov, A.B. Melnikov y Y.M. Kabanov)
- VI Congreso Latinoamericano de Probabilidad y Estadística Matemática, Viña del Mar, Chile, noviembre de 1995. Comunicación: Parada óptima para un proceso con saltos.

- XI Jornadas Anuales de Economía. Diciembre de 1995. Montevideo, Uruguay. Comunicación: Valuación de Opciones Americanas Perpetuas.
- Workshop on the Mathematics of Finance. Montreal, Canadá. 30 de abril al 3 de mayo de 1996. Comunicación aceptada: Pricing options under pure jump information.(no se concretó la participación)
- IV Congreso Dr A. M. Monteiro. Universidad Nacional del Sur. Bahía Blanca República Argentina. 23 al 25 de Abril de 1997. Comunicación: Ruin Probabilities and Optimal Stopping for a Diffusion with jumps.
- Encuentro de Matemática. 3-5 de diciembre de 1997. Centro de Matemática, Montevideo, Uruguay. Comunicación: Desigualdades maximales para procesos de Poisson.
- XIII Jornadas Anuales de Economía. Noviembre de 1998. Comunicación: Parada óptima para una difusión con saltos.
- XIV Jornadas Anuales de Economía. 8 y 9 de noviembre de 1999. Comunicación: Un ejemplo de valuación de opciones en un modelo binomial, (con Juan Cirielli).
- Optimal stoppng and perpetual options for Levy processes. 28/6/00-1/7/00. First World Congress of the Bachelier Finance Society. Paris, Francia.
- XV Jornadas Anuales de Economía. Noviembre de 2000. Comunicación: Opciones rusas para una difusión con saltos. (con Walter Moreira).
- XVI Jornadas Anuales de Economía. Julio de 2001. Comunicación: Pruebas elementales en parada óptima.
- Latin American and Caribbean Economic Association (LACEA) Montevideo 2001 Conference. Comunicación: Bounds on option prices and comparison of statistical experiments for semimartingales.
- XVII Jornadas Anuales de Economía. Julio de 2002. Comunicación: Put-Call duality for option prices in Lévy markets
- "Exact Ruin Probabilities For Lévy processes" Poster at the "Second Bachelier Colloquium on Stochastic Calculus and Finance" (9-15 January 2005, Metabief, France) dedicated to Albert N. Shiryaev on his 70th anniversary.

Evaluación de Proyectos

- Evaluador de proyectos de la CSIC - Comisión Sectorial de Investigación Científica, 1999
- Evaluador de proyectos de la CSE - Comisión Sectorial de Enseñanza, 2000.
- Evaluador de Proyectos del Área Básica del Fondo Clemente Estable (2006).

Arbitraje de Publicaciones Científicas

- Consejero Editorial de Springer Verlag.
- Arbitro (referee) de artículos en las revistas:

- Acta Científica Venezolana
- Annals of Applied Probability
- Annals of Finance (2006)
- Econometrica (2004)
- Finance and Stochastics
- Journal of Actuarial Practice
- Journal of Applied Probability
- Journal of Computational Finance
- Journal of Statistical Physics
- Journal of Theoretical Probability (2004)
- Mathematical Finance
- Publicaciones Matemáticas del Uruguay
- Quantitative Finance
- Stochastic and Stochastic Reports (2006)
- Stochastic Processes and Their Applications (2003, 2006)
- Theory of Probability and Applications (1993)
- Revisor (reviewer) de artículos en
 - Referativni Zhurnal (1991-1995)
 - Mathematical Reviews

Premios y distinciones científicas

- En 1994 obtuve en forma conjunta con A.N. Shiryaev, A.B. Melnikov, Y.M. Kabanov y D.O. Kramkov el premio “Mejor trabajo del año” en el Instituto de Matemática Steklov de la Academia de Ciencias de Rusia.
- Investigador. Proyecto de Desarrollo de Ciencias Básicas, PEDECIBA (grado 3).
- Investigador nacional nivel I, Fondo Nacional de Investigadores, Ministerio de Educación y Cultura. (1999-2001)
- Investigador nacional nivel II, Fondo Nacional de Investigadores, Ministerio de Educación y Cultura. (2002-2004)
- Becario del PEDECIBA (1989-1990) para realizar el Magister en Matemática.
- Becario de la Academia de Ciencias de la URSS (1991-1994) para realizar el Doctorado en Matemática.
- Integrante del Comité Latinoamericano de la Sociedad Bernoulli (febrero 2003-)
- En 1997 fui incluido en la 15 edición de “Who is Who in the World”. Fui nominado para integrar la publicación ”The Barons 500:Leaders for the new century”

Membresía de Sociedades Científicas

- Miembro de la American Mathematical Society (AMS)
- Miembro del Institute for Mathematical Statistics (IMS)

Integración de Tribunales de defensa de Tesis

- Doctorado en Matemática: Isabel Cañette (12/2003), Nancy Guelman (10/2003), Carlos Falcón (14/6/2002).
- Doctorado en Estadística: Fernando Pigeard de Almeida Prado (Universidad de San Pablo, 27/1/2004)
- Magister en Matemática: Walter Moreira (2000), Juan Kalemkerian (11/8/98), Isabel Cañette (12/1998), Graciela Muniz.
- Magister en Física: Estrella Adriana Sicardi (2003).
- Maestría en Ingeniería Ambiental: Gabriela Camps Rey (4/2004)
- Monografía en Matemática: Nicolás Fraiman (12/2005), Diego Armentano (10/2005), Lucía Varela (6/8/2004), María Valentina Vega (30/4/2004), Mario Luzardo, José Eduardo Díaz (21/12/2001), Andrea Mesa (12/1997)
- Licenciatura en Economía: Carlos Frache y Gabriel Katz (6/2004)

Integración de Tribunales de Concursos

- Concurso de Profesor Adjunto (gr. 3) efectivo IMERL, Facultad de Ingeniería.
- Concurso de efectividad para cargos en efectividad en los Centros de Formación Docente (2004)

5 Actividad Profesional

Trabajos de asesoramiento matemático

- 1988. Discusión y proposición de un modelo estadístico para la determinación de la “Máxima ola cincuentenaria” en el diseño de puertos en colaboración con el IMFIA, Facultad de Ingeniería.
- 1989. Proposición de un método automático de conteo de centros en zonas, para la confección de un mapa electrónico de Montevideo, contratado por la empresa MAPINFO, y el Economista Ariel Scarone.
- 1989. Comparación de métodos de crecimiento de hongos. Laboratorio de Estadística, Facultad de Ciencias.
- 1990. Clasificación no paramétrica de pacientes con hidatidosis. Laboratorio de Estadística, Facultad de Ciencias.
- 1990. Estudio de contaminación de playas, en el marco del convenio Intendencia de Montevideo-Facultad de Ingeniería.
- 1990. Diseño de muestreo para relevamiento sobre la situación de la salud en un complejo de Viviendas, contratado por EMAUS.
- 1995. Diseño de una encuesta en el conjunto de los visitantes médicos en la ciudad de Buenos Aires, contratado por la Empresa “Eclipse” (Nelson Ferrer Producciones), Buenos Aires, República Argentina.

6 Actividades de Extensión

Dictado de Conferencias

- 3/9/2003. Gonzalo Pérez Iribarren: Reconstructor del Instituto de Matemática y Estadística. En el “Primer Encuentro Nacional de Jóvenes Matemáticos y Estadísticos. En recuerdo de Gonzalo Pérez Iribarren.”
- 1/4/2004. Teoremas Límites en Probabilidad. Liceo Departamental de Florida, Instituto “Brigadier General Manuel Oribe”

Dictado de cursos breves en el país

- El desafío de la enseñanza de la probabilidad en educación media Jornadas de Probabilidad, 24 y 25 de noviembre de 2005. CERP - Colonia.
- Probabilidad. Curso de Actualización disciplinar en Probabilidad, dirigido a docentes de Enseñanza Secundaria, en el marco de la Transformación de la Educación Media Superior, 19 y 20 de febrero y 3,4,5 de marzo de 2004.
- Modelos matemáticos en finanzas: Valuación de opciones. Curso de actualización para egresados. UPAE, Facultad de Ciencias Económicas y Administración (1998).
- Probabilidad y Estadística, XIX Cursos de Verano de la Universidad de la República (1988).

Artículos, Notas de Cursos

- Accinelli, E. Mordecki, E. Un modelo matemático de la teoría de las finanzas. Revista Análisis, Fundación de Cultura Universitaria, Año 2, número 2. 53-55.
- Mordecki, E. ¿Puede dar pérdida un casino?
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/casinos/>
- Probabilidad. Curso de Actualización disciplinar en Probabilidad, dirigido a docentes de Enseñanza Secundaria, en el marco de la Transformación de la Educación Media Superior. Montevideo, 19 y 20 de febrero y 3,4,5 de marzo de 2004.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/probabilidad/>
- Mordecki, E. Modelos Matemáticos en Finanzas: Valuación de Opciones. Unidad de Perfeccionamiento y Actualización de Egresados (UPAE), Facultad de Ciencias Económicas y Administración. Universidad de la República, 1998, 42 pp.
<http://www.cmat.edu.uy/~mordecki/courses/upae/upae-curso.ps>

Creación de Sitios en Internet

- Gonzalo Pérez Iribarren: In Memoriam
<http://www.cmat.edu.uy/gperezi>
- José Luis Massera (8/6/1915 - 9/9/2002): In Memoriam
<http://www.cmat.edu.uy/massera>

7 Otros méritos y antecedentes

Actividades de Cogobierno Universitario

- Delegado de la ASCEEP-FEUU a la Comisión de Ciencia y Tecnología de la CONAPRO (Comisión Nacional Programática, 1984)
- Delegado estudiantil a la Comisión de Investigación Científica (CIC) del Consejo Directivo Central de la UdelaR (1987-1989)
- Integrante de la Delegación Universitaria en la Primer Comisión Directiva del PEDECIBA (1987 - 1990).
- Delegado docente a la Comisión directiva del Centro de Matemática. (suplente: 1997-1999, titular 1999-2003)
- Integrante de la Comisión del Posgrado del Centro de Matemática -Area Matemática del PEDECIBA (1997-2003)
- Delegado de la Facultad de Ciencias al Consejo Académico de la Licenciatura en Estadística (1998-2001)
- Director del Centro de Matemática de la Facultad de Ciencias (7/2000-7/2001)
- Delegado docente a la Comisión de Enseñanza de de la Facultad de Ciencias (2000-)
- Presidente de la Asamblea del Claustro de la Facultad de Ciencias (2002-2004)
- Coordinador de la Comisión de Informática del Centro de Matemática (desde Julio de 2003)
- Secretario de la Asamblea del Claustro de la Facultad de Ciencias (2004-)
- Delegado Alterno de la Facultad de Ciencias al Consejo Directivo Central de la Universidad de la República (desde agosto de 2002)

Participación en cursos internacionales

- Curso Taller Interamericano sobre Métodos de Muestreo en Poblaciones Biológicas. Centro Interamericano de Enseñanza de Estadística. Santiago Chile (17-11-1986 al 12-12-1986)
- Elementos de Análisis Funcional. Curso de Doctorado. Instituto de Matemática Pura e Aplicada, Rio de Janeiro Brasil. (1987)

Otros méritos y actividades

- Modelos Estocásticos en Finanzas - Informe final del Proyecto CONICYT - BID 325/95