



Víctor Álvarez

Víctor Adrián Álvarez es Actuario por la Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de Buenos Aires y Profesor en Matemática y Cosmografía del Instituto Nacional Superior del Profesorado Joaquín V. González.

Premio Fundación Bolsa de Comercio de Bs. As. al Investigador Científico, Primer premio por el Trabajo de Investigación "La carencia de información relevante: un aspecto clave para el desarrollo del mercado de capitales", 1985.

Primer Premio al Mejor Paper de la XI International Finance Conference, "MARKET CRISES AND VaR ESTIMATION BY EVT: PERFORMANCE IN EMERGING AND DEVELOPED MARKETS, Universidad ESAN, Lima, Perú. 2011

Premio "BEST EMPIRICAL RESEARCH PAPER Award" de la American Academy of Financial Management, por "Has the Basel Committee got it right? Evidence from commodity positions in turmoil" presentado en el 7º. Foro de Finanzas, Administración de Riesgos e Ingeniería Financiera en México. 2014

Comenzó su carrera docente en 1966 como ayudante de Análisis Matemático I en la FCE – UBA. Fue profesor Adjunto, Asociado, Titular y Coordinador de Cátedra de Análisis Matemático I hasta 2002. Creó y organizó en 1991 la Cátedra de Bases Actuariales de las Inversiones y Financiaciones, de la que fue Profesor Titular Regular y Coordinador desde el año 2002 hasta 2012. Profesor de Tópicos de Finanzas Corporativas en la MAESTRÍA EN GESTIÓN ECONÓMICA Y FINANCIERA DE RIESGOS de la Escuela de Estudios de Posgrado de la Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de Buenos Aires desde 2009. Designado en 2012 por el Consejo Superior de la UBA Profesor Consulto Titular de la Facultad de Ciencias Económicas. En 2016 recibió la Medalla por los cincuenta años en la Docencia de esta Casa de Estudios. Fue Coordinador del Proyecto de Investigación UBA - UdeSA: Administración de Riesgos Financieros: su factibilidad, posibilidad de cuantificación y sus limitaciones en países emergentes y desarrollados, que constituye su principal línea de investigación.

Actualmente se desempeña además como Profesor Principal de Cátedra desde 1992 en la Escuela de Negocios de la Universidad de San Andrés en la asignatura Finanzas II (Política y Administración Financiera), y en los cursos de posgrado Evaluación Financiera de Proyectos de Inversión en la Maestría Business & Technology e Introducción al Lenguaje Cuantitativo en la Maestría en Marketing y Comunicación. Fue Director de la Orientación Administración de Empresas desde 2001 hasta 2012. Además se desempeña como consultor independiente.

Fue director de tesis de las Maestrías en Finanzas, en Gestión de Servicios tecnológicos y Telecomunicaciones y M.B.A. de UdeSA. Ha sido designado en varias ocasiones por el Consejo Superior de la UBA para actuar como jurado en concursos abiertos para proveer cargos de profesor en la FCE.

Fue vicepresidente fundador en 1998 de ADA (Argentine Derivatives Association),

Coautor del libro Selección de Inversiones - Introducción a la Teoría de la Cartera (Portfolio Theory), Ediciones Macchi, 1992. Autor de Documentos de Trabajo Docente UdeSA: Nº 13 "Títulos de Deuda (Fixed Income Securities) Aspectos básicos y Valuación", Nº 37 "Títulos de Deuda (Fixed Income Securities): Rentabilidad y Riesgos" y coautor del Nº 62 "Teoría de Valores Extremos (EVT) y grandes crisis financieras.



UBA FCE
Universidad de Buenos Aires
Facultad de Ciencias Económicas

ECON2019
Congreso Internacional de Economía y Gestión

Mercados emergentes vs. Desarrollados” y del N° 63 “Expected Shortfall: a likely change of tack”. Autor “Introducción al Lenguaje Cuantitativo para la Administración de Empresas”, MBA, UdeSA, artículos “La Ecuación de Difusión del Calor y la Valuación de Instrumentos Derivados: de Fourier a Black y Scholes”, 1995, coautor de “Estimación del valor en riesgo mediante teoría de valores extremos. Aplicación a la determinación de capitales mínimos regulatorios”, XII Jornadas Nacionales y Latinoamericanas Actuariales FCE-UBA, 2011 “Leptokurtosis and Backtesting in Basel II and Basel III: regulatory consequences in Emerging and Frontier markets”, Memorias XII Conferencia Internacional de Finanzas, “Financial crisis, Basel II and III minimum capital requirements: adequacy and incentives in non developed markets” Memorias XLVII Asamblea CLADEA 2012, “Expected Shortfall: a likely change of tack”, Papers XLVIII Annual Assembly CLADEA 2013, “Análisis comparativo de técnicas (IMA) para determinar capitales mínimos regulados por Basilea, ante crisis en mercados emergentes”, Revista Odeón, Universidad Externado, Bogotá, Colombia. 2014, “Has the Basel Committee got it right? Evidence from commodity positions in turmoil”, 7º Foro Finanzas, Administración de Riesgos e Ingeniería Financiera, Tecnológico de Monterrey, EGADE Business School, Universidad Autónoma Metropolitana Azcapotzalco y American Academy of Financial Management, premiado y publicado en Volumen 10 Número 1 Enero - Junio 2015 Revista Mexicana de Economía y Finanzas REMEF (The Mexican Journal of Economics and Finance).
