

## Curriculum Vitae

### MÓDULO 1. DATOS PERSONALES

Nombres

FREDY OCARIS

Apellidos

PÉREZ RAMÍREZ

Identificación		Número	Nacionalidad	Sexo	
C.C.	<input checked="" type="checkbox"/>	98.547.751	COLOMBIANA	<input checked="" type="checkbox"/>	Masculino
C.Ext	<input type="checkbox"/>			<input type="checkbox"/>	Femenino
Pas.	<input type="checkbox"/>				

Fecha Nacimiento			Lugar de Nacimiento	Estado Civil
17	09	1969	MEDELLÍN	CASADO
Día	Mes	Año		

Dirección Residencial CALLE 65 N<sup>o</sup>. 48 - 40 (Medellín-Colombia)

Teléfono	371 37 19
Teléfono Celular	3206468178

Dirección Profesional UNIVERSIDAD DE MEDELLÍN. Bloque 4. Oficina 101

Teléfono	340 54 96
----------	-----------

Correo Electrónico foperez@udem.edu.co

## Curriculum Vitae

### MÓDULO 2. NIVEL DE FORMACIÓN

#### Estudios cursados

Modalidad	Título obtenido	Área de estudios	Institución	Duración: Desde-hasta
Pregrado	Matemático	Matemáticas y estadística	U de A	1989-1995
Postgrado	Especialización en Estadística	Estadística	UN sede Medellín	1996-1998
Postgrado	Magíster en Matemáticas Aplicadas	Finanzas y Econometría	EAFIT	2001-2003
Postgrado	Candidato a doctor en Modelación y computación científica	Finanzas y Econometría	U de M	2016- Actualmente

### MÓDULO 3. Experiencia profesional

#### Cargos

Cargo desempeñado	Institución	Duración: Desde – hasta
Profesor tiempo completo	U de M	Desde Agosto de 2003 - Actualmente
Profesor cátedra	EAFIT	Desde 1997- Actualmente Postgrado en la Especialización en Finanzas y en la MAF
Profesor cátedra	EIA	2000-Actualmente
Profesor tiempo completo	U de A	Enero de 1996-agosto de 2003
Profesor cátedra	USB	1995-2002

#### Asesorías en trabajos de grado

Programa	Título del Trabajo de Grado	Institución	Año
Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Modelo econométrico para la estimación de provisiones contra-cíclicas de la cartera de crédito comercial del sector financiero a noviembre 30 de 2005.	Universidad de Medellín	2006

## **Curriculum Vitae**

Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Análisis comparativo de algunos índices bursátiles de países latinoamericanos contra el índice general de la bolsa de valores de Colombia (IGBC)	Universidad de Medellín	2007
Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Impactos y optimización de los apalancamientos financieros en acciones en el mercado de capitales colombiano	Universidad de Medellín	2007
Maestría en Matemáticas Aplicadas	Modelos GARCH asimétricos para estimar la volatilidad en series financieras	Eafit	2009
Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Análisis de la volatilidad del precio de la energía eléctrica en Colombia entre los años 2006 y 2010 utilizando modelos de series de tiempo	Universidad de Medellín	2010
Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Cointegración: Una mirada a los índices bursátiles de América Latina y Estados Unidos entre 1998 y 2010	Universidad de Medellín	2010
Maestría en Finanzas	Construcción de modelos para estimar el nivel de provisiones esperadas para una institución financiera (tres estudiantes)	Universidad de Medellín	2011
Pregrado en Ingeniería Administrativa	Eficiencia de las series arch, garch, egarch y tgarch en la conformación de un portafolio de acciones con el menor riesgo (tres estudiantes)	Escuela de Ingeniería	2012
Maestría en Administración Financiera	Construcción de un portafolio para un ETF del sector minero energético en Latinoamérica mediante modelos de volatilidad condicional heteroscedástica	Eafit	2013
Maestría en Administración Financiera	Análisis econométrico de las acciones de cuatro compañías de la industria del transporte aéreo en Latinoamérica	Eafit	2013
Maestría en Administración Financiera	Diseño de un portafolio de inversión para el fondo regional de garantías de Boyacá y Casanare S.A.	Eafit	2013

## **Curriculum Vitae**

Pregrado en Ingeniería Administrativa	Sistema automático de trading para inversión en el mercado accionario colombiano (tres estudiantes)	Escuela de Ingeniería	2013
Maestría en Administración Financiera	Construcción de un portafolio de Inversión de renta variable y TES mediante modelos de volatilidad para un perfil de riesgo determinado	Eafit	2014
Maestría en Administración Financiera	Impacto de los eventos extremos en la construcción de portafolios de inversión eficientes	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Modelo de predicción de insolvencia financiera aplicado al sector farmaceutico colombiano	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Medición del riesgo de crédito para empresas del sector Cuero calzado en Colombia para el período 2008-2013	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Estimación del riesgo de crédito en una empresa multinacional del sector de muebles	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Una aproximación al cálculo del VaR para las acciones del Mercado Integrado Latinoamericano (MILA) desde metodologías paramétricas y no paramétricas	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Construcción y valoración de un portafolio para un inversionista con un perfil específico	Eafit	2015
Maestría en Administración Financiera	Análisis del efecto que tiene la selección del modelo de construcción de portafolio óptimo y de valoración en riesgo de mercado en la administración de la riqueza	Eafit	2017

### **Experiencia docente**

<b>Programa</b>	<b>Cursos dictados</b>	<b>Institución</b>	<b>Duración: Desde – hasta</b>
Economía	Estadísticas y Cálculos	U de A	1996-2003
Ingenierías Administrativa-Industrial-Civil y Biomédica	Estadísticas, Pronósticos, Cálculos y Ecuaciones diferenciales	EIA	2000-Actualmente

## **Curriculum Vitae**

Ciencias Básicas	Cálculo integral, Álgebra lineal, Ecuaciones diferenciales y Estadística	EAFIT	1997-2007
Ingeniería Financiera	Series de Tiempo, Econometría, Econometría Financiera	U de M	Desde Agosto de 2003
Especialización en formulación y evaluación de proyectos públicos y privados.	Técnicas de Predicción	U de M	2004-Actualmente
Especialización en Finanzas y Mercado de capitales	Econometría Financiera	U de M	2004-Actualmente
Maestría en Administración (MBA)	Métodos cuantitativos	U de M	2007-2009
Especialización en Finanzas	Métodos cuantitativos	EAFIT	2008-Actualmente
Especialización en Gestión Financiera Empresarial	Estadística Aplicada a las Finanzas	U de M	2008-Actualmente
Maestría en Finanzas	Econometría Avanzada	U de M	2010-Actualmente
Maestría en Administración Financiera	Econometría Financiera	EAFIT	2012-Actualmente
Especialización en Estadística	Series de tiempo financieras	EIA	2013- 2014
Especialización Finanzas Corporativas	Estadística Aplicada a las Finanzas	EIA	2016-Actualmente

### **MÓDULO 4. PRODUCCIÓN INVESTIGATIVA**

#### **Proyectos de investigación**

<b>Nombre</b>	<b>Área de trabajo</b>	<b>Institución</b>	<b>Duración: Desde – hasta</b>	<b>Fuentes Financieras</b>
Determinantes de la cuenta corriente en Colombia	Economía y Econometría	U de A	1997-1998	CODI
Convergencia Regional	Econometría	U de A	1999-2002	CODI
Series de tiempo no lineales.	Estadística y Econometría	EAFIT	2002-2003	EAFIT
Variable dependiente limitada	Riesgo de Crédito	U de M	2004	U de M
Predicción de series financieras	Redes Neuronales	U de M	Julio de 2004 a Julio de 2005	U de M
Riesgo crediticio	Redes Neuronales	U de M	2005-2006	U de M

## Curriculum Vitae

Modelación de la volatilidad condicional heteroscedástica de series de tiempo financieras	Series de tiempo	U de M	2006	U de M
Metodologías para la estimación y análisis de estructuras a plazos de tasas de interés e inflación	Derivados	U de M	2007	U de M
Implementación de metodologías de cálculo del valor en riesgo (var) para un portafolio típico colombiano	Riesgo	U de M	2008	U de M
Modelación y pronóstico de variables macroeconómicas para evaluar el desempeño financiero del sector energía eléctrica en Colombia	Riesgo	U de M	2009	U de M
Modelos para determinar estructuras de volatilidad y de tasas de interés	Riesgo	U de M	2010-2011	U de M
Modelo de cuantificación riesgo operacional para la línea banca personal y minorista para entidades financieras del sector cooperativo	Riesgo	U de M	2010-2011	U de m
Construcción de modelos para estimar el nivel de provisiones esperadas para una institución financiera	Riesgo	U de M	2011-2012	U de m
Modelo de cuantificación del riesgo de mercado y riesgo de liquidez. caso de estudio: global securities s.a. comisionista de bolsa	Riesgo	U de M	2012-2013	U de m y Global. Proyecto cofinanciado con Global Securities
Calculo de VaR para diferentes derivados Vigentes en Colombia	Riesgo	U de M	2014-2015	U de M Proyecto cofinanciado la U de A
Estimación de la tasa de cambio	Riesgo	U de M	2016-2017	U de M Proyecto cofinanciado con Nutresa

## Curriculum Vitae

### Pertenencia a grupos o redes de investigación

Nombre del grupo, centro ó red	Director ó Coordinador	Área de trabajo	Institución	Duración: Desde – hasta
CIE	Sergio Restrepo	Econometría	U de A	1998-2003
Modelos Cuantitativos	Hermilson Velásquez, José Valdez	Econometría, Series de Tiempo, Modelos de Inventarios.	EAFIT	2001-2003
GINIF	David Bedoya	Econometría y Riesgo de mercado	U de M	Desde Agosto de 2003
Sociedad Ecuatoriana de Estadística	Gabriela Castro Centeno	Econometría, Series de Tiempo, Modelos de Inventarios.	Quito Ecuador	2015-2016-2017

### MÓDULO 5. PRODUCCIÓN INTELECTUAL

#### Publicaciones: Libros, capítulos, artículos

Título	Autores	Nombre la revista ó libro	Volumen, número ó código ISBN	Año
Determinantes de la cuenta corriente en Colombia	Hector Arango, Elkin castaño, Fredy Pérez, Ramon Mesa, Remberto Rhenals.	Lecturas de Economía	Vol. 50	1999
Modelos Tar para detectar cambios de régimen	Fredy Pérez	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 3 No.5	2004-2
Análisis de Cambio de Régimen en series de tiempo no lineales	Fredy Pérez y Hermilson Velásquez	Lecturas de Economía	Vol. 61	2004
El modelo logístico: una herramienta estadística para evaluar el riesgo financiero	Horacio Fernández C y Fredy Ocaris Pérez R.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 4 No.6	2005-1
Análisis y predicción de la acción de la empresa acerías paz del río utilizando un modelo Garch(1,1) y redes neuronales artificiales	Martha María Gil y Fredy Ocaris Pérez Ramírez	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 4 No.7	2005-2

## Curriculum Vitae

Análisis de la volatilidad del índice general de la bolsa de valores de Colombia utilizando modelos Arch	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Horacio Fernández C.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 5 No.8	2006-1
Modelación de la volatilidad y pronóstico del precio del Café	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Horacio Fernández C.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 5 No.9	2006-2
Las redes neuronales y la evaluación del riesgo de crédito	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Horacio Fernández C.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 6 No.10	2007-1
Introducción a las series de tiempo. Libro resultado de investigación	Fredy O Pérez Ramírez	Lecciones de matemáticas. Sello editorial de la Universidad de Medellín	No. 5	2007-1
Métodos Discretos y Continuos para modelar la densidad de probabilidad de la Volatilidad Estocástica de los rendimientos de series financieras	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 6 No.11	2007-2
Estudio de Efectos Asimétricos y Día de la Semana en el Índice de Volatilidad "VIX"	Fredy Ocaris Pérez Ramírez, Diego Restrepo y Pilar Álvarez.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 6 No.11	2007-2
Modelos ARIMA-ARCH: Algunas aplicaciones a las series de tiempo financieras Libro resultado de investigación	Fredy O Pérez Ramírez	Lecciones de matemáticas. Sello editorial de la Universidad de Medellín	No. 9	2008-1
Modelos discretos y continuos para estimar la densidad de probabilidad de la volatilidad estocastica de los rendimientos de series financieras	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Cuadernos de Administración Universidad Javeriana	Vol. 21 No.36	2008-2
A Comparative Analysis of Models for Estimating the Volatility Distribution of Financial Returns Series	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Revista de Estadística, Economía y Finanzas Aplicadas. México.	Vol. 6 No.9	2008-2
Una Metodología para valorar un callable-bond	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Revista EIA.	No.10	2008-2



## Curriculum Vitae

Econometría. Conceptos básicos. Libro resultado de investigación	Fredy O Pérez Ramírez Horacio Fernández	ECOEDICIONES LTDA	Vol 1	2009
Valor en riesgo para un portafolio con opciones financieras	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Revista Ingenierías Universidad de Medellín	Vol. 9 No.17	2010-2
Valuación de opciones llamables: Modelo de tasa corta de Hull y White	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Carlos Alexander Grajales.	Libro de investigación: Avances recientes en valuación de activos y administración de riesgos. Universidad Panamericana. México	Vol. 2	2011-1
Los modelos simétricos y asimétricos para la estimación de la volatilidad condicional heteroscedástica: diferentes aplicaciones colombianas a la ingeniería financiera	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Lucas Gómez.	Libro de investigación: Modelación y Estrategias en Finanzas. Colombia	Vol. 1	2012-1
Métodos no paramétricos para el análisis de series de tiempo. Libro resultado de investigación	Fredy O Pérez Ramírez	Lecciones de matemáticas. Sello editorial de la Universidad de Medellín	No. 18	2012
Análisis discriminante como seleccionador de variables influyentes en el cálculo de la probabilidad de incumplimiento	Fredy O Pérez Ramírez y Armando Tamara	Revista: Ciencias Estrategicas	Vol. 20 No. 27 pags 103/118 ISSN: 1794-8347	2012
Modelación del precio de la energía eléctrica en Colombia a través de modelos arima-egarch para el periodo 2006-2010	Fredy Ocaris Pérez Ramírez y Felipe Isaza.	Libro de investigación: Modelación y Estrategias en Finanzas. Colombia	Vol. 2 ISBN:978- 958-8815- 28-2	2013-2
Construcción de un portafolio para un ETF del sector minero energético en Latinoamérica mediante modelos de volatilidad condicional heteroscedástica	Fredy Ocaris Pérez Ramírez, Ana María Jimenez y Diego Luis Pinto.	Libro de investigación: Modelación y Estrategias en Finanzas. Colombia	Vol. 2 ISBN:978- 958-8815- 28-2	2013-2

## **Curriculum Vitae**

### **Producción de Software**

<b>Nombre del producto</b>	<b>Autores</b>	<b>Tipo/clase</b>	<b>Contrato Registro</b>	<b>Año</b>
Callable bonds	Carlos Grajales, Fredy Pérez, Diego Restrepo, Juan Camilo Arbelaez y Alex Olano.	Computacional	13-130-185	2011

### **Participación en eventos como ponente**

<b>Título de la ponencia</b>	<b>Nombre y lugar del evento</b>	<b>Código ISBN si hay memorias</b>	<b>Año</b>
Modelos TAR para detectar cambios de régimen en series financieras y económicas.	Primer Simposio de profesores de finanzas. Bogotá.		2004
Modelos TAR para detectar cambios de régimen en series financieras y económicas.	X Encuentro ERM, Medellín.		2004
El modelo logístico: una herramienta estadística para evaluar el riesgo financiero	Segundo Simposio de profesores de finanzas. Bogotá.		2005
Análisis de la volatilidad del índice general de la bolsa de valores de Colombia utilizando modelos arch	XIII Encuentro ERM de carácter internacional. Pereira.		2006
Métodos discretos y continuos para modelar la volatilidad estocástica de los rendimientos de series financieras	IV simposio nacional y I internacional de docentes de finanzas, Cartagena.	ISNN 1900-3218	2007
Modelo de tasa corta de Hull y White y valoración de bonos con opción call	V simposio nacional y II internacional de docentes de finanzas, Medellín.	ISNN 1900-3218 número 4	2008
Estimación de la volatilidad de la distribución de los rendimientos de un activo utilizando ventanas móviles y suavizamiento exponencial	I Encuentro Internacional de Formación y Modelación de las Ciencias Básicas.		2009
Análisis comparativo de algunos índices bursátiles de países latinoamericanos contra el Índice General de la Bolsa de Valores de Colombia (IGBC)	II Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.		2010
Introducción a la Econometría Financiera	VIII Seminario Internacional de Estadística Aplicada. Quito-Ecuador		2013

## **Curriculum Vitae**

VaR para Opciones sobre divisas	VII Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.		2015
Cuantificación del VaR	IX Seminario Internacional de Estadística Aplicada. Quito-Ecuador		2015
Modelos matemáticos para el pronóstico de tasas de cambio monetarias	VIII Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.		2016

### **Asistencia a eventos, capacitaciones, cursos de extensión, entre otros**

<b>Nombre del evento</b>	<b>Horas de duración</b>	<b>Tema</b>	<b>Lugar y año</b>
Primer seminario nacional de Métodos cuantitativos	16	Métodos Cuantitativos aplicados a las finanzas	U de M. 2004
Primer Simposio de profesores de finanzas	16	Modelos VAR, Mercado de futuros y opciones, Econometría.	Bogotá. 2004
Segundo Salón del inversionista	16	Inversiones	U de M. 2004
X Encuentro ERM	40	Matemáticas puras y aplicadas	Universidad de Medellín. 2004
Segundo Simposio de profesores de finanzas	24	Modelos VAR, Mercado de futuros y opciones, Econometría.	Bogotá. 2005
Tercer Salón del Inversionista	16	Inversiones	U de M. 2005
IV Coloquio Internacional: Estadística en las finanzas y en la industria.	16	Riesgo financiero y Diseño de Experimentos	Universidad Nacional sede Medellín y Universidad de Medellín. 2006
XIII Encuentro ERM de carácter internacional. Pereira	40	Matemáticas puras y aplicadas	Universidad tecnológica de Pereira-2006
Seminario de Divulgación Científica	40	Investigación	Universidad de Medellín. 2006
IV Salón del Inversionista	16	Inversiones	Universidad de Medellín. 2006

## **Curriculum Vitae**

IV simposio nacional y I internacional de docentes de finanzas, Cartagena.	24	Mercado de futuros y opciones, Valor en riesgo, Volatilidad, Derivados y Opciones reales.	Universidad tecnológica de Bolívar-Pontificia Universidad JAVERIANA Bogotá. 2007.
VII Jornadas de Investigación-Internacionales, Simposio "Riesgos Económicos y Financieros"	30	Derivados y Opciones reales.	Universidad de Medellín. 2007
V simposio nacional y II internacional de docentes de finanzas, Medellín.	24	Mercado de futuros y opciones, Valor en riesgo, Volatilidad, Derivados y Opciones reales.	Universidad de Medellín-Pontificia Universidad JAVERIANA Bogotá. 2008.
V Salón del Inversionista	16	Inversiones	Universidad de Medellín. 2008
VI Salón del Inversionista	16	Inversiones	Universidad de Medellín. 2009
VII Salón del Inversionista	16	Finanzas Corporativas	Universidad de Medellín. 2010
Cátedra Bursátil	62	Renta Fija, renta variable, derivados y portafolio	Educación BVC. 2011
III Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.	12	Series de Tiempo	Universidad de Medellín. 2011
VIII Coloquio internacional de estadística	32	Métodos estadísticos aplicados a finanzas y gestión de riesgo.	Escuela de Estadística. Universidad Nacional. 2011
VIII Salón del Inversionista	16	Energía	Universidad de Medellín. 2011
IX Salón del Inversionista	16	Riesgo	Universidad de Medellín. 2012
X Salón del Inversionista	16	Crisis Financiera y Gestión del riesgo	Universidad de Medellín. 2013
VIII Seminario Internacional de Estadística Aplicada. Quito-Ecuador	40	Estadística aplicada	Escuela Politécnica Nacional. Quito Ecuador. 2013
VII Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.	12	Series de Tiempo	Universidad de Medellín. 2015
IX Seminario Internacional de Estadística Aplicada. Quito-Ecuador	40	Estadística aplicada	Escuela Politécnica Nacional. Quito Ecuador. 2015
XII Salón del Inversionista	16	Métodos cuantitativos para la toma de decisiones de inversión	Universidad de Medellín. 2015

## **Curriculum Vitae**

VIII Encuentro Internacional de Formación y Modelación en Ciencias Básicas.	12	Derivados financieros	Universidad de Medellín. 2016
---	----	-----------------------	-------------------------------