

Facultad de Economía, Universidad del Rosario,
Casa Pedro Fermín, Calle 12C 4-69 (3-19)
Bogotá – Colombia

Tel: (571) 297 0200 ext. 4142
(57) 310 6184246

E-mail carlos.castro@urosario.edu.co
ccastroiragorri@gmail.com

Website: <https://sites.google.com/site/castroiragorri/home>

Información Personal

Cedula de Ciudadanía: 79.947.917 de Bogotá
Fecha de Nacimiento: Junio 10 de 1978.
Idiomas: Español, Inglés, Francés

Educación

- Universite Libre de Bruxelles, Bélgica, PhD en Economía, 2010.
 - Titulo disertación doctoral, “Essays in Dependence and Optimality in Large Portfolios”
- Universite Libre de Bruxelles, Bélgica, Magíster en Estadística, 2007.
- Universidad de los Andes, Colombia, Magíster en Economía, 2001.
- Universidad de los Andes, Colombia, Economía, 2000.

Intereses de Investigación:

Principales: Econometría financiera, Administración de Riesgos.

Secundarios: Matemática Financiera, Series de Tiempo, Economía Financiera.

Experiencia laboral

- Profesor Principal, Facultad de Economía, Universidad del Rosario. Agosto 2010-
Funciones: profesor de asignaturas a nivel de pregrado y postgrado, creación y dirección de la Maestría en Finanzas Cuantitativas, realizar proyectos de investigación propios y financiados en el área de Finanzas Cuantitativas.
- Contrato de investigación, Dept. of Financial Stability, National Bank of Belgium, Diciembre 2009- Junio 2010.
Funciones: preparar un artículo técnico analizando críticamente las técnicas de medición del riesgo sistémico en el sistema financiero.
- Credit Portfolio Modeling department, Dexia sa, 11 Rogier Square, Bruselas, Bélgica, Consultor (Estudiante de Doctorado), 2007-2009.
Funciones: Investigar, diseñar e implementar el módulo de dependencia entre activos del modelo de riesgo crediticio del portafolio.
- Subdirección de Estudios Sectoriales y de Regulación, Dirección de Estudios Económicos, Departamento Nacional de Planeación (DNP) Bogotá, Colombia. Consultor (verano 2008), Subdirector (2004-2005), Asesor (2002-2003) y Contratista (2001-2002).
Funciones: coordinar la agenda de investigación de la Dirección (modelos de pronóstico, modelos de equilibrio general computable, modelos de pensiones y salud, entre otros), preparar el documento CONPES macroeconómico, desarrollar modelos de pronósticos de diferentes variables económicas.
- Centro de Estudios sobre Desarrollo Económico (CEDE), Universidad de los Andes, Bogotá, Colombia. Asistente de Investigación, Verano 2000.
Funciones: Construir una base de datos con indicadores contables del sector financiero colombiano

Publicaciones

En revistas especializadas.

- Default risk in agricultural lending, the effects of commodity price volatility and climate, *Agricultural Finance Review*, 74 (4), Octubre 2014, pp 501-521. (with K. Garcia).
- Measuring and Testing for Systemically important Financial Institutions, *Journal of Empirical Finance*, Volume 25, Enero 2014, Pages 1–14, (con S. Ferrari).
- Confidence sets for asset correlations in portfolio credit risk, *Revista de Economía del Rosario*, Vol. 15, No. 1, 2012.
- Portfolio choice under local industry and country factors, *Financial Markets and Portfolio Management*, 24(4), Diciembre 2010.
- Eficiencia-X en el sector bancario colombiano, *Desarrollo y Sociedad*, Septiembre 2001, 48, pp. 1-52.

Documentos de Trabajo.

- La administración cuantitativa del riesgo financiero en la provisión de un plan de salud, Universidad del Rosario, Facultad de Economía, Documento de trabajo. 163. pp. 23.
- Stock return co-movements and integration within the Latin American integrated market, April, 2014, (with N.J. Marin), Universidad del Rosario, Facultad de Economía, documento de trabajo, no. 154.
- Default risk in agricultural lending: the effects of commodity price volatility and climate, IDB working paper series no. No. IDB-DP 362
- Measuring and Testing for Systemically important Financial Institutions, Mayo, 2012, (con S. Ferrari), Universidad del Rosario, Facultad de Economía, Documento de trabajo. 101.
- A Network model of systemic risk: identifying the sources of dependence across institutions, Octubre, 2012, (con J.S. Ordoñez), Universidad del Rosario, Facultad de Economía, Documento de trabajo, 121.
- Administración de riesgos en los Fondos Privados de Pensiones, *Archivos de Economía*, No. 351, Departamento Nacional de Planeación (DNP), Bogotá, Colombia, Enero 2009.
- El comercio internacional y la productividad total de los Factores en Colombia., *Archivos de Economía*, No. 307, Departamento Nacional de Planeación (DNP), Bogotá, Colombia, Enero 2006, (con J.R Perilla y O. Gracia).
- Un Modelo Gravitacional para la Agenda Interna., *Archivos de Economía*, No. 296, Departamento Nacional de Planeación (DNP), Bogotá, Colombia, Enero 2005, (con Lozano C., Campos, J.S.).
- Yet another lagging, coincident and leading index for the Colombian Economy, *Archivos de Economía*, No. 233, Departamento Nacional de Planeación (DNP), Bogotá, Colombia, Septiembre 2003.
- Sistema de modelos multivariados para la proyección del Producto Interno Bruto, *Archivos de Economía*, No. 232, Departamento Nacional de Planeación (DNP), Bogotá, Colombia, Septiembre 2003.

En libros y/o revistas.

- Measuring the systemic importance of financial institutions using market information, en *Financial stability review*, National Bank of Belgium, Junio 2010, pp. 127-141 (con S. Ferrari).
- Uncertainty in asset correlation for portfolio credit risk: the shortcomings of the Basel II framework, *Proceedings CREDIT Conference Credit Risk, Financial Crises, and the Macroeconomy*, Vol. 2, Venecia, Italia, Septiembre 2009.
- Eficiencia, competencia y márgenes de intermediación en *El sector financiero de cara al siglo XXI*, ANIF, Noviembre de 2002, Tomo 1, (con R. Steiner).
- El PIB potencial y la brecha del PIB en *Carta Financiera*, ANIF, Enero de 2005, (con J. Rodriguez).

- Otra mirada al margen de intermediación financiera, Separata Especial, *Portafolio-DNP*, Septiembre 2001, (con N. Salazar).

Docencia y administración académica:

- First international conference on Actuarial Science and Quantitative Finance, Bogota, Junio 17-20, 2014, 2016: Miembro del comité organizador.
- Universidad del Rosario: Miembro del Comité de la Escuela Doctoral (2011-), Director Maestría en Finanzas Cuantitativas (2012-).
- Universidad del Rosario: Introducción a las Ciencias Económicas, 2011; Teoría Financiera 1(Maestría), 2013, Econometría (pregrado, maestría y doctorado), (2010-); Tópicos en Macroeconometría (Maestría), profesor asistente, 2003-II
- Universidad de los Andes: Econometría Intermedia (Pregrado), profesor asistente, 2001-2002.

Becas y distinciones

- Fondo de Investigaciones de la Universidad del Rosario (FIUR), 2013, COP \$20'000,000.
- Financiación para investigación, MAP-BID, 2012-2013, €20,000.
- Fondo de Investigaciones de la Universidad del Rosario (FIUR), 2010-2011, COP \$20'000,000.
- Beca para estudios Doctorales (Bourse de Doctorat), Universite Libre de Bruxelles, 2007-2009.
- Beca-Préstamo, Fondo DNP-FONADE-ICETEX, 2005, 2006, 2007.
- Beca ALBAN, Union Europea, 2005, 2006.

Habilidades en sistemas

- Microsoft Certified Professional (MCP ID #2953622), Designing and Implementing Desktop Applications with Microsoft Visual Basic 6.0.
- Microsoft Office, Access, FrontPage, R, STATA, SPSS, RATS, GiveWin, PC-Give, Ox, GAUSS, Matlab, E-Views, R, WinBugs, C++, Pajek.

Actividades editoriales:

- Revisar artículos para la revista y publicaciones: *Archivos de Economía (DNP)*, *Planeación y Desarrollo (DNP)*, *Ensayos sobre Política Económica (Banco de la República de Colombia)*, *Cuadernos de Economía (UN)*, *Coyuntura Económica (Fedesarrollo)*, *Advances in Decision Sciences*, *Financial Markets and Portfolio Management*, *International Review of Economics and Finance*, *ODEON – Universidad Externado de Colombia*.

Supervisión de Tesis y agendas de investigación:

- Lina Camero (Maestría en Economía, Enero 2012): “Ajuste de riesgo en el Sistema de Salud en Colombia, una aplicación de los modelos multinivel”.
- Juan Sebastian Ordoñez (Programa Nacional de jóvenes Investigadores, Colciencias, 2011-2013): Objetivo: Mediante técnicas de Administración de Riesgos cuantitativos, identificar los problemas que se presentan por las falencias en la distribución del riesgo a lo largo de la cadena del sector salud en Colombia.
- Juan Sebastian Ordoñez (Maestría en Economía, 2014): “Un modelo espacial para cuantificar la fragilidad bancaria en Colombia”.
- Johana Marín Rodríguez (Doctorado en Economía, 2013-2017): “Medidas de riesgo y diversificación de portafolio”.