

Seminario Aleatorio

Sesión 284

Inferencia Bayesiana no paramétrica en la asignación de activos

Juan Carlos Martínez-Ovando
Departamento de Actuaría y Seguros, ITAM

Resumen

En este trabajo planteamos el problema de asignación de activos (portafolios de inversión) como un problema de decisión bajo un ambiente de incertidumbre. El planteamiento de este problema es de naturaleza predictiva. Así, el enfoque Bayesiano de inferencia surge de manera natural. Adicionalmente, incorporamos un componente no paramétrico basado en mezclas de distribuciones normales sesgadas, con el propósito de modelar la dependencia entre los activos de manera flexible. Mostramos que la solución óptima del problema puede obtenerse a través de un procedimiento pseudo-aleatorizado sobre el espacio de decisiones. Comentamos sobre ventajas y limitaciones del procedimiento propuesto, revisando casos particulares que emergen de usar funciones de utilidad basadas en momentos y en la noción de aversión al riesgo.

Viernes 27 de noviembre de 2015, 13:00 hrs.
Aula B-4, Plantel Río Hondo

El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes, por lo que el Departamento de Estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.

En la red: <http://estadistica.itam.mx/es/51/contenido/seminario-aleatorio-de-estadistica>