Departamento Académico de Estadística
Río Hondo # 1, Col. Progreso Tizapán,
México, D. F., C.P. 01080

Seminario Aleatorio

Sesión 294

Sobre la Predictibilidad de Precios de Activos Financieros

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

Resumen

Se ha documentado que ciertos patrones observados en la evolución de los precios o retornos de los activos financieros están asociados con la posibilidad de predecir niveles futuros de precios. En esta plática revisaremos algunos de estos patrones, y desarrollamos estrategias para vincular algunos de esos patrones con modelos Bayesianos de series de tiempo, particularmente modelos no paramétricos. Ilustraremos estas consideraciones con un estudio predictivo sobre precios de una moneda virtual en alta frecuencia.

Viernes 6 de mayo de 2016, 13:00 hrs.
Aula B-3, 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