El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

ANALISIS BAYESIANO DE PRECIOS DE FUTUROS DEL PETROLEO

(Este es un trabajo conjunto con Dr. Mike West)
(Duke University, USA)

Dra. Viridiana Lourdes de León
Depto. De estadística
ITAM

RESUMEN

El comportamiento estocástico de los precios del petróleo juega un papel importante en la evaluación de activos y proyectos relacionados con el petróleo. Nosotros desarrollamos un modelo para precios del petróleo explotando una estructura latente común en series múltiples de precios de futuros del petróleo.
Estos modelos están basados en Teorías económicas tradicionales del comportamiento del precio de materias primas a corto y largo plazo.
La estructura del modelo incluye ideas de matrices de observación singulares y modelos de factores.

Fecha: ***Viernes 13 de octubre***
Hora: ***12:30***
Salón: ***314***

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.