

El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Teoría de Valores Extremos

impartirá

VICTOR MANUEL FENTON NAVARRO

Riesgos de Mercado

Grupo Financiero Santander Serfin

RESUMEN

La gran mayoría de los eventos manejados en finanzas, hidrología, cálculos actuariales y riesgos de mercado, crédito y operacionales tienen distribuciones de probabilidad de colas anchas pesadas. El estimar dichas probabilidades es fundamental para múltiples fines generales y particulares en cada campo de aplicación. La Teoría de Valores Extremos nos ayuda en dicho cometido. Es una serie de técnicas que han tomado auge en los últimos años, impulsadas principalmente por las ciencias actuariales y las finanzas modernas. En esta plática se darán los fundamentos, bosquejo de la Teoría y aplicaciones, a manera de introducción y de motivación para su estudio.

Fecha Viernes 22 de Febrero

Hora: 16:30

Salón: 205

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.