

El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Un estudio sobre probabilidades de impago con variables aleatorias intercambiables utilizando el problema de momentos de Markof-Chebichef

impartirá

Dr. José Luis Farah
Departamento de Matemáticas
ITAM

RESUMEN

El impago de créditos otorgados a un grupo supuestamente homogéneo de acreedores se modela con una sucesión de variables intercambiables para la cual la representación clásica de De Finetti es válida. Esta representación utiliza una distribución condicionante. Este resultado permite calcular la probabilidad de impago de cualquier número de créditos, y con este modelo, el primer y segundo momentos de la distribución condicionante, son justamente la probabilidad individual de impago y la covarianza entre pares de impagos, respectivamente.

Se caracteriza en forma exacta la probabilidad máxima de impago de cualesquiera número de impagos en términos de estos dos parámetros, para lo cual se utiliza un resultado general de problemas de extremo en la Teoría general de momentos (Krein, Karlin & Studden, Kemperman).

Se comenta sobre la utilización de técnicas bayesianas relacionadas con este problema.

Fecha: Viernes 8 de marzo

Hora: 16:00

Salón: 311

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.