

El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Estrategias de Rotación: Un Modelo Bayesiano

impartirá

Viridiana Lourdes (Expositor)
Departamento de Estadística, ITAM
Omar Aguilar
Merrill Lynch

RESUMEN

En esta plática discutiremos una clase de modelos dinámicos múltiples para series de tiempo bajo un enfoque Bayesiano.

Estos modelos han sido diseñados para explicar el comportamiento del mercado accionario a través de estrategias que alternan el riesgo en diferentes sectores industriales. El modelo utiliza la capacidad predictiva de las industrias y sectores económicos para predecir el comportamiento del mercado. Los modelos son una directa generalización de los modelos factoriales de Aguilar y West (2000).

Discutiremos diferentes estrategias de rotación incluyendo la implementación de portafolios dinámicos así como la evaluación del modelo, y los algoritmos MCMC usados para estimar esta nueva clase de modelos.

Fecha: Viernes 12 de abril

Hora: 12:30

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.