

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Teorías coherentes de Riesgo: Una Introducción al tema

impartirá

Henryk Gzyl

**Departamento de Cómputo y Estadística
Universidad Simón Bolívar**

RESUMEN

Para poner el tema de este ensayo sobre el tapete, comenzaremos con la siguiente cita a Allan Greenspan:

There are some who would argue that the role of bank supervision is to minimize or even to eliminate bank failure; but this view is mistaken in my judgment. The willingness to take risk is essential to growth of a free market economy. If all savers and financial intermediaries invested only in risk-free assets, the potential for business growth would never be realized.

Para lo que nos ocupa aquí, la palabra clave en el texto anterior es riesgo. Y las preguntas asociadas son: De qué se trata? Cómo se define, mide o caracteriza el riesgo? Cuáles son los criterios bajo los cuales la supervisión pasa a regulación? Y aún más: Cómo lo podemos usar a nuestro favor? El tema de este ensayo, basado en una conferencia dictada en el IESA, es pasar revista a como se arma una Teoría coherente de riesgo (y el énfasis esta en los requerimientos que hacen que una medida de riesgo sea coherente) y describir superficialmente como una medida de riesgo se puede usar para hallar portafolios eficientes.

Fecha: Viernes 11 de Abril

Hora: 12:30

Salón: Sala de Videos II, Biblioteca 2. Piso

Lista de seminarios próximos. Visite:

www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html

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.