



Departamento Académico de Estadística

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Métodos Numéricos en Teoría de Riesgo.

Impartirá

DR. MOGENS BLADT

IIMAS - UNAM

RESUMEN

En esta plática introducimos la clase de distribuciones tipo fase cuya popularidad en el área de teoría de riesgo proviene de su flexibilidad y su tratabilidad matemática.

Las distribuciones tipo fase tienen colas ligeras, se pueden aproximar a cualquier distribución concentrada sobre el eje positivo y permiten calcular propiedades como la probabilidad de ruina de manera explícita o algorítmica.

En un modelo para la reserva de riesgo bastante general calculamos la probabilidad de ruina exacta usando argumentos probabilísticos. La presentación también incluye aspectos de procesos de renovación, procesos escalonados y unos aspectos estadísticos sobre la estimación de distribuciones tipo fase.

Fecha: Viernes 26 de Marzo

Hora: 12:30 hrs.

Salón: Sala de Videos 2 - 2º. Piso Biblioteca

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.

María F. Rojano Agraz
ITAM
Depto. Académico de Estadística
Rio Hondo # 1,
Col. Tizapán San Angel
C.P. 01000 México, D. F.
Tel. 5628-4000 ext. 3803
Fax 5628-4086