



Departamento Académico de Estadística

*El Departamento de Estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión de

## ***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que con el título

*Un enfoque de regresión a selección de portafolio*

Impartirá

**Jorge de la Vega  
Banco de México**

### **RESUMEN**

El objetivo de esta plática es mostrar cómo se puede plantear el problema de portafolio de mínima varianza como un problema de mínimos cuadrados y cómo se puede plantear el problema en un contexto bayesiano que permite introducir dinámica en la estimación. A su vez, varios problemas inherentes al enfoque clásico de Markowitz pueden simplificarse con este enfoque. La plática está orientada a una aplicación concreta.

***Fecha: Viernes 5 de Noviembre***

***Hora: 12:50 hrs.***

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

**Lista de seminarios próximos. Visite:**

[http://estadistica.itam.mx/seminarios\\_prox.html](http://estadistica.itam.mx/seminarios_prox.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