



Departamento Académico de Estadística

*El Departamento de Estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión (No. 185) de

## ***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que, con el título

### **Maximización de utilidad robusta para funciones de utilidad logaritmo**

impartirá

**Daniel Hernández Hernández**  
**Área de Probabilidad y Estadística**  
**CIMAT**

#### **Resumen**

Motivados por la necesidad de medidas de riesgo robusta, se presenta la solución del problema de maximización robusta cuando el espacio de probabilidad puede ser perturbado en algún sentido. Utilizando técnicas de control estocástico y ecuaciones diferenciales parciales se resuelve el problema explícitamente cuando la función de utilidad es del tipo logaritmo.

***Fecha: Viernes 22 de Agosto***

***Hora: 13:00 hrs.***

***Salón: B-2***

**Lista de seminarios próximos. Visite:**

<http://estadistica.itam.mx/seminarios.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