Departamento Académico de Estadística

El Departamento Académico de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 249) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

"*Aplicaciones de la teoría de fluctuaciones para procesos de Lévy espectralmente negativos en teoría del riesgo*"

Impartirá

Dr. José Luis Pérez Garmendia
Departamento de Estadística, ITAM

Resumen

Daremos una breve introducción intuitiva a ciertas aplicaciones de procesos de Lévy espectralmente negativos a la teoría del riesgo. Empezaremos analizando el modelo clásico de riesgo de Cramér-Lundberg explicando de manera intuitiva la importancia de este modelo y su respectiva generalización en los modelos conocidos como procesos de Lévy de riesgo. Posteriormente expondremos las nociones de la teoría de Gerber-Shiu para procesos de Lévy de riesgo, incluyendo problemas recientes como: la medida de Gerber-Shiu, y la optimalidad para el problema de control de De Finetti. Finalmente concluiremos la plática hablando sobre la noción de modelos de riesgo con instrumentos de retraso Parisíno.

Fecha: Viernes 13 de Septiembre de 2013
Hora: 13:00 hrs.
Salón: B-3, Plantel Río Hondo

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.

Trinidad Martínez
ITAM
Depto. Académico de Estadística
Rio Hondo # 1,
Col. Progreso Tizapán
C.P. 01080 México, D. F.
Tel. 5628-4000 ext. 3803
Fax 5628-4086
E-mail: trinidad@itam.mx