

Seminario Aleatorio

Sesión 308

Selección de carteras con base en valor en riesgo y en déficit esperado.

Juan Carlos Martínez-Ovando
ITAM

Resumen

El valor en riesgo (VaR) y el déficit esperado (ES) son actualmente dos medidas de riesgo populares sobre las que se formulan estrategias para la construcción de carteras en finanzas y seguros. En esta presentación ofrecemos una perspectiva predictiva y desarrollamos una estrategia computacional para estimar tanto el VaR como el ES predictivos. Además, se identifica la asignación óptima de cartera. El enfoque es flexible en tanto que la distribución predictiva del vector de incertidumbre o riesgo se estima no paramétricamente y la estrategia de cartera se calcula teniendo en cuenta el riesgo de estimación subyacente al modelo. Ilustramos el método propuesto con el desarrollo de dos marcos empíricos para encontrar la estrategia óptima de reaseguro de cuota-parte basada en datos simulados y reales.

Viernes 7 de abril de 2017, 13:00 hrs.
Aula B5, Plantel Río Hondo

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.

En la red: <http://estadistica.itam.mx/es/51/contenido/seminario-aleatorio-de-estadistica>