Seminario 414: Cotas semiparamétricas: un enfoque práctico

Seminario 414: Cotas semiparamétricas: un enfoque práctico
Profesor Asistente, Tilburg School of Economics and Management, Tilburg University

Entrada libre. Indispensable inscribirse en el siguiente vínculo: Inscripciones

Hora: 12:00 m. (refrigerio) y 12:30 p. m. (inicio del seminario)

Tiempo de exposición: 12:30 p. m. a 2:00 p.m.

Lugar: Edificio del Banco de la República, Carrera 7 #14-78, piso 13 (Sala de prensa)

Resumen del documento: Recientemente se ha demostrado como calcular numéricamente cotas semiparamétricas en la rentabilidad y / o los precios esperados de instrumentos financieros (o actuariales) usando optimización semidefinida. Este enfoque tiene limitaciones prácticas serias, por tanto, teniendo como meta un enfoque más práctico, nos fijamos en las instancias del problema de las cotas semiparamétricas donde se pueden utilizar técnicas de optimización lineal. En este seminario se dará una introducción al problema de las cotas semiparamétricos en general y su solución mediante optimización semidefinida. A continuación, se presentan ejemplos de instancias en las que se pueden utilizar técnicas de optimización lineal. A saber, el cálculo de precios de (canastas de) opciones europeas y los pagos esperados de algunos instrumentos actuariales. No se requiere ningún conocimiento previo en optimización. El presentador espera despertar el interés de la audiencia sobre el uso de este método para calcular rentabilidad y / o los precios esperados de los instrumentos financieros (o actuariales) que le interesen.

Si desea inscribirse a la lista de correos del Seminario semanal de Economía de Bogotá para recibir en su cuenta la información sobre nuestra programación, debe remitir un correo electrónico a la dirección seminariossemanales@banrep.gov.co con el asunto "Inscripción a la lista de correos", cabe resaltar que por esta cuenta no se reciben inscripciones a los seminarios. Consulte nuestras Políticas y lineamientos generales de protección de datos personales.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/sse-bogota-414