



Sistema Integral de Información Académica
Coordinación de Planeación, Evaluación y
Simplificación de la Gestión Institucional
Reporte individual



MOGENS BLADT PETERSEN

Datos Generales

Nombre: MOGENS BLADT PETERSEN

Máximo nivel de estudios: DOCTORADO

Antigüedad académica en la UNAM: 22 años

Nombramientos

Último: INVESTIGADOR TITULAR B TC Definitivo
Instituto de Investigaciones en Matemáticas
Aplicadas y en Sistemas
Desde 01-02-2012 hasta 31-07-2018

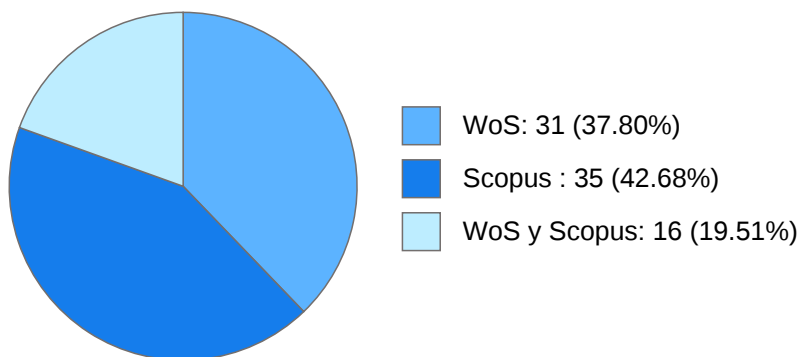
Estímulos, programas, premios y reconocimientos

SNI II - 2020
PRIDE D 2013 - 2018
PRIDE C 2012 - 2013
PRIDE Fijo 2012
PRIDE C 2012
PRIDE Fijo 2010 - 2012
PRIDE D - 2010

MOGENS BLADT PETERSEN

DOCUMENTOS EN REVISTAS

Histórico de Documentos



#	Título	Autores	Revista	Año
1	Fitting inhomogeneous phase-type distributions to data: the univariate and the multivariate case	MOGENS BLADT PETERSEN Albrecher H. Yslas J.	SCAND J STAT	2022
2	From PH/MAP to ME/RAP	MOGENS BLADT PETERSEN Asmussen S.	QUEUEING SYSTEMS	2022
3	Gram-Charlier methods, regime-switching and stochastic volatility in exponential Lévy models	MOGENS BLADT PETERSEN Asmussen S.	QUANTITATIVE FINANCE	2022
4	Moments and polynomial expansions in discrete matrix-analytic models	MOGENS BLADT PETERSEN Asmussen S.	STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS	2022
5	Mortality modeling and regression with matrix distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Albrecher H. Yslas J.	INSURANCE MATHEMATICS & ECONOMICS	2022
6	Erratum: Simple simulation of diffusion bridges with application to likelihood inference for diffusions (Bernoulli (2014) 20 (645-675) DOI: 10.3150/12-BEJ501)	MOGENS BLADT PETERSEN Mider M. Sørensen M.	Bernoulli	2021

MOGENS BLADT PETERSEN

7	Fluctuation theory for one-sided Lévy processes with a matrix-exponential time horizon	MOGENS BLADT PETERSEN Ivanovs J.	STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS	2021
8	Multivariate phase-type theory for the site frequency spectrum	MOGENS BLADT PETERSEN Hobolth A. Andersen L.N.	JOURNAL OF MATHEMATICAL BIOLOGY	2021
9	Multivariate fractional phase-type distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Albrecher H.	Fractional Calculus and Applied Analysis	2020
10	Matrix representations of life insurance payments	MOGENS BLADT PETERSEN Asmussen S. Steffensen M.	European Actuarial Journal	2020
11	Matrix Mittag-Leffler distributions and modeling heavy-tailed risks	MOGENS BLADT PETERSEN Albrecher H.	Extremes	2020
12	Inhomogeneous phase-type distributions and heavy tails	MOGENS BLADT PETERSEN Albrecher H.	JOURNAL OF APPLIED PROBABILITY	2019
13	Phase-type distributions in population genetics	MOGENS BLADT PETERSEN Hobolth A. Siri-Jégousse A.	THEORETICAL POPULATION BIOLOGY	2019
14	Fitting phase-type scale mixtures to heavy-tailed data and distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Rojas-Nandayapa L.	Extremes	2018
15	Preface	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen B.F.	Probability Theory And Stochastic Modelling	2017
16	Matrix-Exponential Distributions in Applied Probability	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen B.F.	Probability Theory And Stochastic Modelling	2017
17	Simulation of multivariate diffusion bridges	MOGENS BLADT PETERSEN Finch, Samuel Sorensen, Michael	JOURNAL OF THE ROYAL STATISTICAL SOCIETY SERIES B-STATISTICAL METHODOLOGY	2016
18	On the use of functional calculus for phase-type and related distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Navarro, Azucena Campillo Nielsen, Bo Friis	STOCHASTIC MODELS	2016

MOGENS BLADT PETERSEN

19	Saddlepoint approximation to gamma convolutions	MOGENS BLADT PETERSEN Choi Y.-H. Cho J.-R. et al.	Proceedings of the Jangjeon Mathematical Society	2016
20	Calculation of ruin probabilities for a dense class of heavy tailed distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen, Bo Friis Samorodnitsky, Gennady	SCANDINAVIAN ACTUARIAL JOURNAL	2015
21	Simple simulation of diffusion bridges with application to likelihood inference for diffusions	MOGENS BLADT PETERSEN Sorensen, Michael	Bernoulli	2014
22	Bilateral Matrix-Exponential Distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Esparza L.J.R. Nielsen B.F.	Springer Proceedings in Mathematics & Statistics	2013
23	MOMENT DISTRIBUTIONS OF PHASE TYPE	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen, Bo Friis	STOCHASTIC MODELS	2011
24	FISHER INFORMATION AND STATISTICAL INFERENCE FOR PHASE-TYPE DISTRIBUTIONS	MOGENS BLADT PETERSEN Esparza, Luz Judith R. Nielsen, Bo Friis	JOURNAL OF APPLIED PROBABILITY	2011
25	MULTIVARIATE MATRIX-EXPONENTIAL DISTRIBUTIONS	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen, Bo Friis	STOCHASTIC MODELS	2010
26	ON THE CONSTRUCTION OF BIVARIATE EXPONENTIAL DISTRIBUTIONS WITH AN ARBITRARY CORRELATION COEFFICIENT	MOGENS BLADT PETERSEN Nielsen, Bo Friis	STOCHASTIC MODELS	2010
27	Efficient estimation of transition rates between credit ratings from observations at discrete time points	MOGENS BLADT PETERSEN Sorensen, Michael	QUANTITATIVE FINANCE	2009
28	PRICING DERIVATIVES INCORPORATING STRUCTURAL MARKET CHANGES AND IN TIME CORRELATION	MOGENS BLADT PETERSEN ENRIQUE MENDEZ RIOS PABLO PADILLA LONGORIA	STOCHASTIC MODELS	2008
29	Stochastic Models: Preface	MOGENS BLADT PETERSEN Mimbela J.A.L. Ruiz De Chavez J. et al.	STOCHASTIC MODELS	2006
30	Statistical inference for discretely observed Markov jump processes	MOGENS BLADT PETERSEN Sørensen M.	JOURNAL OF THE ROYAL STATISTICAL SOCIETY SERIES B-STATISTICAL METHODOLOGY	2005
31	A Review on Phase-type Distributions and their Use in Risk Theory	MOGENS BLADT PETERSEN	ASTIN BULL	2005
32	Matrix-exponential distributions: Calculus and interpretations via flows	MOGENS BLADT PETERSEN Neuts M.F.	STOCHASTIC MODELS	2003

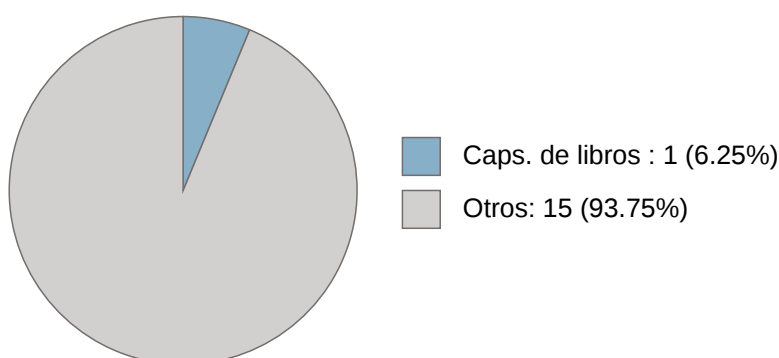
MOGENS BLADT PETERSEN

33	Point processes with finite-dimensional conditional probabilities	MOGENS BLADT PETERSEN Asmussen S.	STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS	1999
34	An actuarial approach to option pricing under the physical measure and without market assumptions	MOGENS BLADT PETERSEN Rydberg T.H.	INSURANCE MATHEMATICS & ECONOMICS	1998
35	The variance constant for the actual waiting time of the PH/PH/1 queue	MOGENS BLADT PETERSEN	ANNALS OF APPLIED PROBABILITY	1996

MOGENS BLADT PETERSEN

LIBROS Y CAPITULOS CON ISBN

Obras con registro ISBN



#	Título	Autores	Alcance	Año	ISBN
1	Preliminaries on Stochastic Processes	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
2	Matrix-Exponential Distributions in Applied Probability Preface	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Editorial Material	2017	9781493970490
3	Martingales and More General Markov Processes	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
4	Phase-Type Distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
5	Matrix-Exponential Distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
6	Renewal Theory	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
7	Random Walks	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490

MOGENS BLADT PETERSEN

8	Regeneration and Harris Chains	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
9	Multivariate Distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
10	Markov Additive Processes	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
11	Markovian Point Processes	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
12	Some Applications to Risk Theory	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
13	Statistical Methods for Markov Processes	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
14	Estimation of Phase-Type Distributions	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
15	Matrix-Exponential Distributions in Applied Probability Appendix A	MOGENS BLADT PETERSEN Bo Friis Nielsen	Article	2017	9781493970490
16	Bilateral matrix-exponential distributions.	MOGENS BLADT PETERSEN	Capítulo de un Libro	2013	9781461449089



Sistema Integral de Información Académica
Coordinación de Planeación, Evaluación y
Simplificación de la Gestión Institucional
Reporte individual



MOGENS BLADT PETERSEN

PARTICIPACIÓN EN PROYECTOS

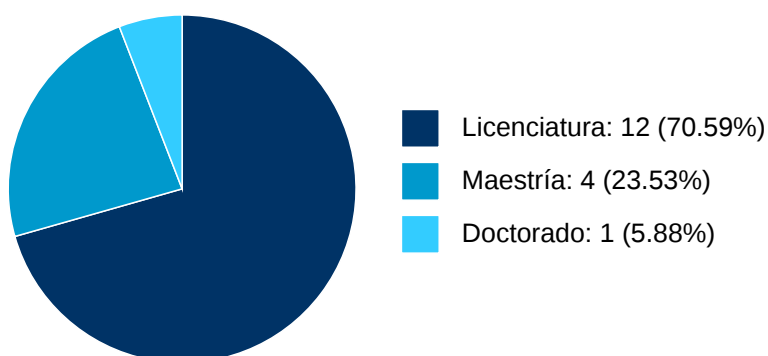
No se encuentran registros en la base de datos de SISEPRO asociados a:

MOGENS BLADT PETERSEN

MOGENS BLADT PETERSEN

PARTICIPACIÓN EN TESIS

Histórico de Colaboraciones en Tesis



#	Título del documento	Tipo de Tesis	Sinodales	Autores	Entidad	Año
1	Strassens theorem and erlangization : applications to risk theory	Tesis de Maestría	MOGENS BLADT PETERSEN,	Peralta Gutiérrez, Oscar,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2015
2	Distribuciones de momentos tipo fase y matriz exponencial	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Iniesta Miranda, José Rodrigo,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2015
3	Modelos de reserva con reclamaciones tipo fase y matriz exponencial	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Peralta Gutiérrez, Oscar,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2013
4	Valuación de opciones en mercados incompletos	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Pescador Jiménez, Gustavo Eduardo,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2011

MOGENS BLADT PETERSEN

5	Estimation of discretely observed Markov processes	Tesis de Doctorado	MOGENS BLADT PETERSEN,	Baltazar Larios, Fernando,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2011
6	Distribuciones matriz exponenciales	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Pimentel Rosas, Mario Edgar,	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas,	2008
7	Riesgo de credito	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Díaz Ordoñez, Edgar,		2007
8	Estimacion de un proceso de Markov discretamente observado	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Hernandez Hernandez, Miguel,		2007
9	Analisis estocastico no estandar y su aplicacion en finanzas	Tesis de Maestría	MOGENS BLADT PETERSEN,	Delgado Vences, Francisco Javier,		2007
10	Puentes markovianos	Tesis de Maestría	MOGENS BLADT PETERSEN,	Rodriguez Esparza, Luz Judith,		2007
11	Probabilidades de ruina	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Hernandez Godinez, Julissa,		2007
12	Procesos de Levy y la descomposicion de Levy-Ito	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Delgado Vences, Francisco Javier,		2005
13	Distribuciones de tiempos de ocupacion y ganancias en cadenas de Markov a tiempo continuo	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Jasso Fuentes, Hector,		2002
14	Uso de los procesos arma en la formula de Samuelson para valuacion de derivados	Tesis de Maestría	MOGENS BLADT PETERSEN,	Mena Chávez, Ramsés Humberto,		2000
15	Metodos analiticos y nunmericos en matematicas financieras	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Mendez Rios, Enrique,		2000

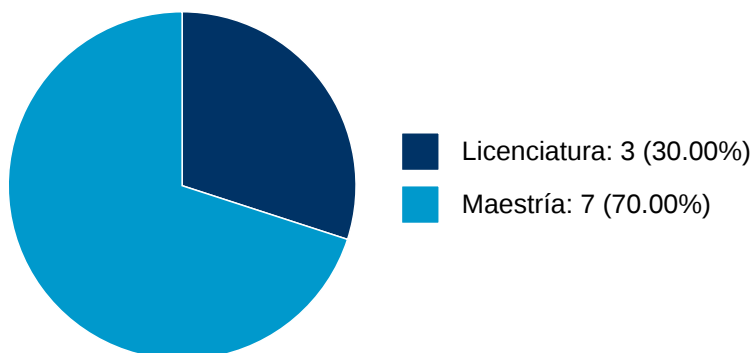
MOGENS BLADT PETERSEN

16	Teoría racional de opciones	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Fuentes García, Ruth Selene,	1999
17	Precios de valores derivados en un mercado con riesgos externos	Tesis de Licenciatura	MOGENS BLADT PETERSEN,	Mena Chávez, Ramsés Humberto,	1999

MOGENS BLADT PETERSEN

DOCENCIA IMPARTIDA

Histórico de docencia



#	Nivel titulación	Asignatura	Entidad	Alumnos	Semestre
1	Maestría	CURSO AVANZADO DE PROBABILIDAD,PROBABILIDAD APLICADA	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	7	2018-1
2	Maestría	TEORIA DE RIESGO	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	4	2015-2
3	Licenciatura	SEM MATEMATICAS APLICADAS I	Facultad de Ciencias	13	2014-2
4	Maestría	PROBABILIDAD II	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	4	2013-2
5	Maestría	CURSO AVANZADO DE PROBABILIDAD	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	7	2012-2
6	Licenciatura	TEORIA DEL RIESGO	Facultad de Ciencias	48	2011-2
7	Licenciatura	TEORIA DEL RIESGO	Facultad de Ciencias	22	2010-2
8	Maestría	TEORIA DE RIESGO	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	6	2010-2



Sistema Integral de Información Académica
Coordinación de Planeación, Evaluación y
Simplificación de la Gestión Institucional
Reporte individual



MOGENS BLADT PETERSEN

9	Maestría	CURSO AVANZADO DE ESTADISTICA	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	7	2009-2
10	Maestría	CURSO AVANZADO DE PROBABILIDAD	Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas	12	2009-1



Sistema Integral de Información Académica
Coordinación de Planeación, Evaluación y
Simplificación de la Gestión Institucional
Reporte individual



MOGENS BLADT PETERSEN

PATENTES

No se encuentran registros en la base de datos de patentes asociados a:

MOGENS BLADT PETERSEN

MOGENS BLADT PETERSEN

FUENTES DE INFORMACIÓN

Internos

#	Información	Fuente	Sistema	Periodo
1	Grupos ordinarios y resumen de historias académicas	DGAE	SIAE	2008-2025
2	Nombramientos, datos generales, estímulos, premios y reconocimientos	DGAPA	RUPA	2008-2025
3	Producción Académica	CH	Humanindex	2008-2021
4	Producción Académica	CIC	SCIC	2000-2017
5	Proyectos	DGPO	SISEPRO	2018-2022
6	Tesis	DGB	TESIUNAM	2008-2025
7	Tutorías en Posgrado	CGEP	SIIPosgrado	2008-2021

Externos

#	Información	Fuente	Sistema	Periodo
8	Documentos Indexados	Elsevier	Scopus	2008-2025
9	Documentos Indexados	Thomson Reuters	WoS	2008-2025
10	Obras con registro ISBN	INDAUTOR	Agencia ISBN	2008-2025
11	Patentes	IMPI	SIGA	2008-2024