

Seminario Aleatorio

Sesión 392

Quitando el ruido browniano de una señal con saltos

Jorge González Cazares

Department of Statistics. University of Warwick

https://warwick.ac.uk/fac/sci/statistics/staff/research_students/gonzalez/

Resumen

Usando la simetría en los incrementos de un movimiento browniano, veremos cómo toda trayectoria browniana es, heurísticamente, el resultado de una permutación infinitesimal y un valor final. En particular, usaremos esta propiedad para remover el ruido browniano de una señal con saltos.

**Viernes 09 de septiembre de 2022,
13:00 horas de CDMX,**

<https://itam.zoom.us/j/98379219720?pwd=REw4RE45SjY5a3JvV0ZCWTVkWkowUT09>

ID de reunión: 983 7921 9720

Código de acceso: 686126

El Seminario Aleatorio del Departamento de Estadística del ITAM está destinado tanto a profesores como a estudiantes, por lo que se agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.