

El Departamento Académico de Estadística del ITAM
anuncia la siguiente sesión (No. 264) de

EL SEMINARIO ALEATORIO
que, con el título

*Detección de puntos de cambio en regímenes
markovianos. Un enfoque Bayesiano no paramétrico*

Impartirá

Asael Fabian Martínez Martínez
*Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas
Universidad Nacional Autónoma de México.*

Resumen

El problema de detección de puntos de cambio consiste en encontrar variaciones abruptas en el comportamiento del fenómeno bajo estudio. En esta plática se presenta un modelo para enfrentar este problema bajo una perspectiva Bayesiana no paramétrica. Nuestro modelo se basa en la fórmula de muestreo de Pitman para funciones de probabilidad sobre particiones intercambiables, la cual modela todos los posibles puntos de cambio. Las observaciones dentro de cada régimen son modeladas a través de un proceso markoviano. Asimismo, se provee un nuevo método Monte Carlo vía cadenas de Markov para simular de la distribución posterior correspondiente. El desempeño del modelo se ilustra utilizando datos simulados, así como un conjunto de datos reales.

Fecha: Viernes 10 de octubre 2014
Seminario: 13:00 h.
Salón: B- 1, Plantel Río Hondo

Lista de seminarios próximos. Visite:

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

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.

ITAM, Departamento Académico de Estadística
Río Hondo # 1, Col. Progreso Tizapán,
México, D. F., C.P. 01080