



Seminario Aleatorio

Sesión 269

Distribuciones predictivas conjugadas y entropías generalizadas

Eduardo Gutiérrez Peña

IIMAS - UNAM

Resumen

Las familias exponenciales pueden derivarse como distribuciones de máxima entropía dadas ciertas restricciones sobre algunos de sus momentos. En este trabajo se discute una generalización de este resultado, al considerar distribuciones predictivas conjugadas (que se obtienen a partir una distribución muestral de la familia exponencial junto con la correspondiente distribución conjugadas estándar). Dichas distribuciones predictivas: (i) tienen como caso límite a la distribución muestral que les dio origen; y (ii) maximizan una entropía generalizada que tiene como caso límite a la entropía de Shannon. En este sentido, se puede considerar que la distribuciones predictivas conjugadas pertenecen a una "familia exponencial generalizada". También se discuten algunas de las implicaciones de estas ideas.

Viernes 05 de diciembre 2014, 13:00 hrs.

Salón: B- 1, 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.