

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

***ESTIMACION DE LOS VALORES CRITICOS
DE LA PRUEBA DE ESPECIFICACION
DE BIERENS MEDIANTE BOOTSTRAP***

será impartida por el

***Dr. Manuel A. Domínguez
Departamento de Estadística
ITAM***

RESUMEN

En esta plática se muestra que la distribución de los estadísticos propuestos por Bierens (1982, 1990) y Bierens y Ploberger (1997) para probar la bondad del ajuste de modelos de regresión puede estimarse mediante bootstrap. Un pequeño experimento de Monte Carlo parece indicar que estos estimadores son más precisos que los obtenidos utilizando el método de simulación propuesto por los autores. También se compara el comportamiento en muestras finitas de este procedimiento de prueba con el propuesto en Stute (1997) y Stute et al. (1998).

Fecha: Viernes 26 de marzo

Hora: 13:00

Lugar: Salón 301, 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.