El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

PROPIEDADES ASINTOTICAS DE MODELOS LINEALES CON ERRORES DE LARGA MEMORIA IRREGULARMENTE OBSERVADOS

será impartida por

*Wilfredo Palma*P. Universidad Católica de Chile

RESUMEN

Esta charla discute algunas propiedades asintóticas de los estimadores de parámetros de modelos lineales con regresores estocásticos y errores con larga memoria. El comportamiento de los estimadores de mínimos cuadrados y máxima verosimilitud en muestras grandes es estudiado bajo varios esquemas muestrales, incluyendo patrones determinísticos y estocásticos. Estos resultados teóricos son ilustrados con simulaciones Monte Carlo y dos aplicaciones a datos reales.

Fecha: Viernes 12 de mayo

Hora: 12:30 Lugar: Salón LI-2

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.