

# *El Departamento de estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión de

## ***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que con el título

***A consistent test of the Martingale difference hypothesis***

impartirá

**Manuel A. Domínguez**  
**Centro de Investigación Económica y**  
**Departamento de Estadística**  
**ITAM**

### ***RESUMEN***

According to Economic Theory, some random processes should behave as a martingale difference. In Statistics, martingale difference assumption allows us to find suitable convergence results. In this paper we develop a method for checking if a random process is a martingale difference.

The resulting test is consistent and although it relies in a tests statistic that is not (asymptotically) distribution free, bootstrap allows to estimate the case dependent critical values. That statistic resembles the Cramer-vonMises Goodness of fit test. Thus, although it is nonparametric in spirit, it does not require any smoothing.

Este Seminario ser dictado en español.

***Fecha: Viernes 4 de Octubre***  
***Hora: 12:30***  
***Salón: Sala de Video I Biblioteca, 2. Piso***

***Lista de seminarios próximos. Visite:***

**[www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html](http://www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html)**

*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.*