



El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Propiedades de la diagonal empírica de una cópula y una prueba no paramétrica de independencia para la familia arquimedea

Impartirá

José Ma. González-Barrios
IIMAS-UNAM e ITAM

RESUMEN

El problema de determinar si dos variables aleatorias son independientes ha sido de gran interés, y se han escrito muchos trabajos con distintas propuestas para analizarlo. En el caso de variables aleatorias continuas, la teoría de cópulas ha permitido analizar en detalle los distintos tipos de dependencia.

En esta plática veremos que dentro del entorno de las cópulas arquimedea, toda la información de la cópula se localiza en la diagonal, y que la cópula de independencia pertenece a esta familia. La ventaja de esta caracterización dentro del mundo arquimedea es la reducción de dimensionalidad. Usaremos la versión empírica de la diagonal de la cópula analizando sus propiedades, para proponer una prueba de independencia para la familia arquimedea. También haremos comparaciones con algunas otras medidas de dependencia para checar la potencia de nuestra prueba.

Fecha: Viernes 10 de Marzo

Hora: 12:50 hrs.

Salón: Sala de Videos 2 - 2º. Piso Biblioteca

Lista de seminarios próximos. Visite:

http://estadistica.itam.mx/seminarios_prox.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.

María F. Rojano Agraz
ITAM
Depto. Académico de Estadística
Rio Hondo # 1,
Col. Tizapán San Angel
C.P. 01000 México, D. F.
Tel. 5628-4000 ext. 3803
Fax 5628-4086