

El Departamento Académico de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 210) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

Teoría de Valores Extremos, el caso bivariado

impartirá

Antonio Ortíz B.
Universidad de Kent, UK

Resumen

Durante la última década, la Teoría de Valores Extremos (TVE) ha visto un gran desarrollo. Sin embargo, el caso multivariado, ya que se presentan más complicaciones en las distribuciones, principalmente en la estructura de dependencia. Hasta ahora, el caso bivariado ha sido el foco de atención en la TVE multivariada.

Uno de los conceptos más importantes dentro de esta teoría es la dependencia en colas, la cual es simplemente la medida de dependencia entre dos variables, dado que una de ellas es de magnitud extrema. La mayoría de los enfoques que se encuentran actualmente en la literatura usan las cópulas para modelar esta dependencia, acarreando así, varias imprecisiones en la inferencia.

Presentamos en nuestro proyecto un modelo que no está basado en cópulas.

Trabajamos con los datos con un modelo paramétrico simple, el cual nos ofrece una estimación sencilla de la dependencia en colas y el cual no presenta las dificultades que el uso de cópulas ha mostrado hasta ahora.

Fecha: Viernes 20 de Agosto

Hora: 13:00 hrs.

Salón: B-3

Lista de seminarios próximos. Visite:

<http://estadistica.itam.mx/seminarios.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

Río Hondo # 1,

Col. Tizapán San Angel

C.P. 01000 México, D. F.

Tel. 5628-4000 ext. 3803

Fax 5628-4086