

El Departamento Académico de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 217) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

Inferencia Bayesiana para procesos de difusión con trayectorias reales

impartirá

**Isadora Antoniano
Universidad de Kent, Reino Unido**

Resumen

Los procesos de difusión con trayectorias reales son utilizados como modelos estadísticos en diversas áreas. Para ello, se recurre generalmente a su representación en términos de Ecuaciones Diferenciales Estocásticas. La inferencia, en este contexto, se refiere a los parámetros que aparecen en los coeficientes de deriva y de difusión de dichas ecuaciones.

El método de aceptación y rechazo conocido como Simulación Exacta, permite la estimación bayesiana vía MCMC. Al introducir variables latentes de dimensión variable y potencialmente infinita, la representación utilizada para llevar a cabo la simulación, transforma el modelo en un modelo Bayesiano no paramétrico. La interpretación de dichas variables latentes es relevante para algunas propiedades de los estimadores bayesianos y de máxima verosimilitud, en particular la consistencia.

Adicionalmente, la representación de los procesos de difusión derivada de la Simulación Exacta, admite generalizaciones que permiten definir otros tipos de procesos estocásticos con trayectorias continuas en los reales, los cuales pueden, a su vez, resultar útiles como modelos estadísticos.

Fecha: Viernes 7 de Enero

Hora: 13:00 hrs.

Salón: Salón B-2, Plantel Río Hondo

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