



El Departamento Académico de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 232) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

Sobre modelos estacionarios coherentes ante marginalización

Impartirá

Juan Carlos Martínez-Ovando
Banco de México

(trabajo conjunto con S.G. Walker, University of Kent)

Resumen

El muestreador de Gibbs, combinado con modelos de mezcla, se ha utilizado como un instrumento para construir modelos estacionarios para series de tiempo con densidades (o distribuciones) marginales y de transición dadas. Aparte de una propuesta reciente, hasta ahora tal construcción se ha restringido a definir modelos estacionarios de primer orden.

En esta plática, presentamos un marco extendido simple que da origen a modelos estrictamente estacionarios con estructuras de dependencia arbitrariamente altas, los cuales son coherentes ante marginalización. Tal propiedad nos permite la posibilidad de desarrollar inferencias coherentes y predicciones. La inferencia estadística en el tipo de modelos propuestos es factible a través de procesos latentes. Se discuten una ilustración y temas potenciales de investigación relacionados.

Algunas palabras claves: Estacionariedad; Estructuras de la dependencia; Mezclas dinámicas; Coherencia ante marginalización; Muestreador de Gibbs; Procesos latentes.

Fecha: Viernes 27 de Enero de 2012

Hora: 13:00 hrs.

Salón: Salón B-1, 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
Rio Hondo # 1,
Col. Tizapán San Angel
C.P. 01000 México, D. F.
Tel. 5628-4000 ext. 3803
Fax 5628-4086
E-mail: mrojano@itam.mx