

SEMINARIO ALEATORIO 446

SELECCIÓN Y PONDERACIÓN DE MODELOS COMO PROBLEMAS DE ESTIMACIÓN

RESUMEN:

La selección de modelos puede verse como un problema de estimación puntual sobre una clase extendida de modelos definidos de manera apropiada. En esta charla, exploramos esta idea desde un punto de vista bayesiano. En el contexto de la perspectiva "M-cerrada", y bajo ciertos supuestos, estimar el valor del parámetro que corresponde al modelo verdadero lleva a diversas formas del factor de Bayes. Por otro lado, bajo la perspectiva "M-completa", el procedimiento propuesto es análogo a un tipo de estimación máximo-verosímil, y puede ser útil para determinar pesos apropiados para la ponderación de modelos.

Presentado por



EDUARDO GUTIÉRREZ PEÑA

IIMAS, UNAM

Investigador Titular B en el Departamento de Probabilidad y Estadística del Instituto de Investigaciones en Matemáticas Aplicadas y en Sistemas (IIMAS) de la UNAM.

Obtuvo la licenciatura en Actuaría por la UNAM, la Maestría en Estadística en el IIMAS y el Doctorado en Estadística en el Imperial College London del Reino Unido. Ha sido Vicepresidente y Presidente de la Asociación Mexicana de Estadística (AME) y es miembro electo del International Statistical Institute.

Fue ganador del Jan Tinbergen Award en 1997, del mismo instituto. Es miembro del SNII, nivel III, desde 2016. Su investigación se desarrolla en el área de la Estadística Bayesiana.

Detalles del evento:

 **Fecha:** Viernes 21 de noviembre del 2025

 **Hora:** 12:00 (Hora Centro de México)

 **Ubicación:** Salón 317