

El Postgrado en Modelos Aleatorios de la Facultad de Ciencias,
Universidad Central de Venezuela

INVITATA

A todas aquellas personas interesadas en asistir, al Seminario titulado:

“Procesos estocásticos con cambio de régimen markoviano, con aplicación a series de tiempo de viento.”

**Profesor invitado : Lisandro Fermín
CIMFAV UNIVERSIDAD DE VALPARAISO**

Resumen: Se dará una introducción a modelos estocásticos con cambio de régimen markovianos (HMM, MS-AR, MS-AR), donde se presentarán resultados acerca de la estabilidad de soluciones, propiedades, estimadores y convergencia asintótica. En particular, se darán resultados sobre un nuevo algoritmo de tipo Robins-Monro para la estimación no-paramétrica del modelo MS-AR. La presentación será ilustrada con una aplicación en la modelización estocástica para series de tiempo de viento con la finalidad de obtener nuevos indicadores que permitan un estudio de zonas con potencial para la producción de energía eólica.

Fecha: Miércoles 11 de febrero 2015

Hora: 4:00 PM

Lugar: Sala Raimundo Chela

