

# Estimación de procesos autorregresivos con régimen de Markov.

*Luis RODRIGUEZ*

CIMFAV, Facultad de Ingeniería, Universidad de Valparaíso.

Jueves 9 de enero 2014

**Abstract:** Introducimos algunas técnicas de estimación para el proceso autorregresivo de orden 1 controlado por una cadena de Markov no observada. Entre los problemas de estimación estudiados están, estimación de los parámetros del modelo por medio del algoritmo SAEM, estimación penalizada del número de estados de la cadena no observada y estimación semiparamétrica de la densidad del ruido.