

Estimación adaptativa de la función de densidad en un punto fijo bajo dependencia

Karine BERTIN

CIMFAV, Facultad de Ingeniería, Universidad de Valparaíso.

Miercoles 30 de abril.

Resumen: Se observa un proceso dependiente a tiempo discreto que admite una densidad marginal común f . Construimos un estimador para f en un punto fijo x que está basado en el método de Goldenshluger-Lepski. Este método nos permite obtener estimadores adaptativos de la densidad, es decir estimadores que convergen a la velocidad óptima y además la construcción de estos estimadores es totalmente data-driven y bien calibrada.