

MAT.
87
1984

UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES
FACULTAD DE CIENCIAS EXACTAS Y NATURALES

DEPARTAMENTO: **MATEMATICA**

ASIGNATURA: **SEMINARIO DE PROCEDIMIENTOS ESTADISTICOS ROBUSTOS**

CARRERA/S: **Doctorado**

ORIENTACION: PLAN:

CARACTER: **Optativo**

DURACION DE LA MATERIA: **Cuatrimestral**

HORA DE CLASE:

a) TEORICAS ⁴	hs.
b) PRACTICAS	hs.
c) TEORICO PRACTICAS	hs.
d) TOTALES ⁴	hs.

ASIGNATURAS CORRELATIVAS: **No tiene**

PROGRAMA:

- Curva de influencia. Sensibilidad a errores groseros. Teorema de Hampel.**
- Curva de cambio de varianza.**
- Estimadores óptimos para el modelo lineal.**
- Curva de influencia para series de tiempo.**
- Estimadores óptimos para modelos autoregresivos.**
- Punto de ruptura.**
- Estimadores para el modelo lineal con alto punto de ruptura.**

BIBLIOGRAFIA

Hampel, F.R. (1968) Contributions to the theory of robust estimation Ph.D. Tesis, University of California, Berkeley.

Krasker, W.S. (1980) Estimation in linear regression models with disparate data points Econometrics 48, 1333-1346.

Ing. PEDRO E. ZADUNAISKY

P. Zadunaisky

DIRECTOR INTERINO
DEPARTAMENTO DE MATEMATICA

Aprobado por Resolución *AN 270/85*

SEMINARIO DE PROCEDIMIENTOS ESTADÍSTICOS ROBUSTOS

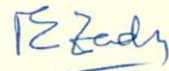
1er. cuatrimestre de 1984.

- Krasker, W. S. and Welsch, R. T. (1982) Efficient bounded influence regression estimation. J. American Stat. Assoc. 77 595-604.
- Marenda, R. A. and Yehai, V. J. (1981) Asymptotic behavior of general M-estimates for regression and scale with random carriers. Z. Wahrscheinlichkeitstheorie and Verw. Gebeite 58, 7-20.
- Rousseuw, P. J. and Yehai, V. J. (1984). Robust regression by means of S-estimators. In Robust and Nonlinear Time Series, Franke, Hardle and Martin eds. Springer-Verlag, New York, N. Y.
- Kunsch, (1982). The influence function and optimal robust estimates for time series. To appear in Ann. of Statist.
- Martin and Yehai (1984) Influence curves for time series Technical Report n° 51 Department of Statistics University of Washington.

Firma del profesor:



Aclaración de firma: Dr. Victor J. Yehai



Ing. PEDRO E. ZADUNAISKY

DIRECTOR INTERINO
DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICA