

Resultados asintóticos para la estimación de parámetros de procesos ARX en seguimiento de trayectorias

Víctor Hugo Vázquez Guevara ¹

*Facultad de Ciencias Físico Matemáticas
Benemérita Universidad Autónoma de Puebla*

Resumen:

En esta plática se considerarán procesos ARX con parámetros desconocidos en 2 etapas:

1. primero se considerará el caso vectorial, en donde se presentarán propiedades asintóticas de los estimadores mínimos cuadrados y mínimos cuadrados ponderados. Cabe mencionar que se consideran dos versiones del control de seguimiento de trayectoria y que, en cada una de ellas el juego de hipótesis es ligeramente diferente;
2. a continuación, se considerará el caso escalar y la posibilidad de que el ruido asociado tenga una correlación lineal de orden uno. Se discutirán entonces propiedades asintóticas del estimador de mínimos cuadrados, de la estadística de Durbin-Watson y del estimador de parámetro de autocorrelación. Finalmente, se presentará una versión del Teorema del Límite Central casi seguramente, así como estimadores consistentes de los momentos de orden par del ruido.

Miércoles 30 de junio
Hora 14:00 Plataforma Zoom
ID Reunión Zoom: 870 9431 8552
Contraseña: 1Pm5*qdzb\$

¹vvazquez@fcfm.buap.mx