



Proyecto n° PI-03-4943-2002

Identificación de modelos AR, ARMA y markovianos no estacionarios

Responsable: **Castro Cabrera, Glaysar María**

Etapas cumplidas / Etapas totales 2/2

Especialidad: Matemática

Resumen: Encuentra condiciones para determinar en qué casos de los modelos del título son soluciones que maximizan un criterio de entropía. Además construye un algoritmo para obtener un filtro AR para procesos bidimensionales.

Productos

Publicaciones

Artículos

1. G. Castro, "Coeficientes de reflexión vs autocorrelaciones parciales", *Divulgaciones Matemáticas*, **15**(2), 149-160, 2007.
2. G. Castro y V. Girardin, "Characterization of periodically correlated multivariate stationary discrete wide Markov processes", *Statistics & Probability Letters*, **78**, 158-164, 2008.

Eventos

G. Castro, "Algoritmos para obtener extensiones de covarianzas bidimensionales", *XVIII Jornadas Venezolanas de Matemáticas*, Facultad de Ciencias, UCV, 2005.