

Seminário

Grupo de Probabilidades e Estatística

24 de abril de 2024

15:00

Zoom Meeting

Sobre (in)dependência de cauda

Marta Ferreira

Centro de Matemática, Universidade do Minho, Portugal

Abstract

A ocorrência de valores extremos numa variável pode contagiar outras variáveis. Medidas habituais de dependência baseadas na parte central dos dados falham na captação de dependência ao nível extremal. No âmbito da teoria de valores extremos foram desenvolvidas metodologias para o efeito, como o coeficiente de dependência residual, particularmente importante num contexto em que os dados são escassos. Serão abordadas algumas metodologias de estimação conhecidas na literatura.

Este seminário será transmitido via Zoom, através do link:

<https://videoconf-colibri.zoom.us/j/98681843630?pwd=d0pBS0dBV1hDVnBBSExGWUgwMXFyUT09>

ID da reunião: 986 8184 3630

Senha da reunião: 714414

This seminar is supported by CIDMA – Center for Research and Development in Mathematics and Applications through FCT – Fundação para a Ciência e a Tecnologia, within projects UIDB/04106/2020 and UIDP/04106/2020, with links <https://doi.org/10.54499/UIDB/04106/2020> and <https://doi.org/10.54499/UIDP/04106/2020>.