

MI678--Teoria Assintótica

Ementa:

Ordem de magnitude e expansão de Taylor; convergência estocástica; teorema centrais do limite; comportamento assintótico de distribuições empíricas e estatísticas de ordem; comportamento assintótico de estimadores e estatística de testes: EMV; testes da razão de verossimilhança; Wald e escore e eficiência assintótica; teoria assintótica em dados categorizado; normalidade assintótica local.

Referências:

1. Billingsley, Patrick. Probability and measure. John Wiley & Sons, 2008;
2. Sen, P.K. and Singer, J.M. Large Sample Methods in Statistics. An introduction with applications. New York: Chapman and Hall, 1993;
3. Serfling, R.J. Approximation Theorems of Mathematical Statistics. New York, John Wiley, 1980;
4. Ibragimov, J.A. and Khasminskii, R.Z. Statistical Estimation Asymptotic Theory. Springer-Verlog. New York Heidelberg Berlin, 1981.
5. Lehmann, E. L. Elements of large-sample theory. Springer Science & Business Media, 2004.
6. Van der Vaart, A. W. Asymptotic statistics (Vol. 3). Cambridge university press. 2000.

Avaliação:

1a. Prova (P1) - 50% - dia 02/05 (terça)

2a. Prova (P2) - 50% - dia 15/06 (quinta)

Exame (E) dia 11/07 (terça)

Média sem exame(M): $M = (50 \times P1 + 50 \times P2) / 100$

Se $5,0 \leq M$, aluno aprovado. Caso Contrario, aluno para exame.

Atendimento:

Veronica: Quintas das 09 as 10 hs, sala 207-IMECC