

Actividades Formativas IMEIO/ Educational Activities IMEIO

Título/Title: Análisis de valores extremos con R / Extreme value analysis with R
Organizador/Organizer: Fátima Palacios Rodríguez fpalacios2@us.es
Profesores/Lecturers: Fátima Palacios Rodríguez
Horas totales/Number of hours: 5 horas/ 5 hours
Lugar/Location: On-line
Fechas/Dates: 11-12 de enero de 2023/ 11th-12th january 2023

Resumen/Summary:

La estadística clásica se centra en la modelación del promedio de la distribución de la variable de interés. En la teoría de los valores extremos el interés principal no está en el promedio, sino en los valores más bajos o más altos de la variable bajo estudio, es decir, en los eventos asociados a la cola de la distribución. Dicha teoría nos permite estudiar el comportamiento de fuertes corrientes marinas, el aumento repentino del flujo de un río, los bruscos cambios de decremento o aumento del valor de una acción en el mercado, etc. Este curso se centra en los conceptos fundamentales de la teoría de valores extremos univariantes tratando la aplicación práctica con el software R.

Classical statistics focuses on modeling the average of the distribution of the variable of interest. In Extreme Value Theory, the main interest is not in the average, but in the lowest or highest values of the studied variable, that is, in the events associated with the tail of the distribution. This theory allows us to study the behavior of strong ocean currents, the quickly increase in the flow of a river, the sudden changes of decrease or increase in the value of a share in the market, etc. This course is concentrated on the fundamental concepts of univariate Extreme Value Theory, treating the practical application with R software.

¿Aceptarías que el curso se pudiera emitir por videoconferencia restringido a algunos alumnos del doctorado que no pudieran asistir presencialmente? Este curso es on-line.

Would you accept that the course could be given by videoconference restricted to some doctoral students who could not attend in person? This course is on-line.