

# **Método para detectar correlaciones no lineales en series de tiempo multivariadas a través del cómputo de la matriz de correlación de distancias**

*Wednesday 13 December 2023 16:00 (20 minutes)*

Presentaré un método para detectar correlaciones no lineales en series de tiempo multivariadas a través del cómputo de la matriz de correlación de distancias. Este método funciona aún cuando se utiliza en series de tiempo cortas porque, al contrario de lo que ocurre con la matriz de correlación de Pearson, su espectro de eigenvalores no se degenera. De manera que es factible detectar cambios rápidos en la dinámica de un sistema complejo sin perder significancia estadística por usarlo en ventanas de tiempo cortas.

## **Resumen de la contribución**

**Author:** MOTA NAVARRO, Roberto (ICF, UNAM)

**Presenter:** MOTA NAVARRO, Roberto (ICF, UNAM)

**Session Classification:** Contribuciones Orales