El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Bayesian analysis of econometric time series models using hybrid integration rules

será impartida por el

Dr. Dani Gamerman
Instituto de Matemáticas
Universidad Federal de Rio de Janeiro

RESUMEN

This talk is concerned with the study of Bayesian inference procedures applied to commonly used time series models in econometrics. The structural vector auto regressive models are considered in detail. Inference procedures are based on a hybrid integration scheme where state parameters are analytically integrated and hyperparameters are integrated by markov chain Monte Carlo methods. Credibility regions for forecasts and impulse responses are then derived. The procedures are illustrated with an application in macroeconomic monetary policy.

Fecha: ***Martes 8 de septiembre***
Hora: ***18:00***
Lugar: ***Salón 305 Río Hondo***

El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes por lo que el Departamento de Estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.