Departamento Académico de Estadística
Río Hondo # 1, Col. Progreso Tizapán,
México, D. F., C.P. 01080

Seminario Aleatorio

Sesión 270

Modelación Bayesiana de Series de Tiempo y Aplicaciones en Econometría

Juan Carlos Martínez Ovando

Banco de México

Resumen

En esta presentación, revisaremos los fundamentos de la modelación bayesiana de series de tiempo, tanto para el análisis como para la predicción. Comentaremos sobre el flujo de información, el mecanismo bayesiano para la actualización de creencias, y la incorporación de información adicional relevante. Dos aplicaciones en macroeconometría van a ser revisadas:

i) modelación de micro-datos de precios y el ajuste de fijación de precios
ii) predicción macroeconómica.

En (i), se introduce una nueva construcción de modelos de duración marcados usando estructuras latentes, los cuales se emplean para describir las estrategias de fijación de precios que las empresas mexicanas siguen para ajustar sus precios. En (ii), vamos a revelar la importancia de la incorporación de información relevante para la predicción macroeconómica mediante una combinación de opiniones de los expertos. Se comentarán algunos resultados empíricos en ambos contextos, junto con algunos temas de investigación futura relacionados.

Viernes 23 de enero 2015, 13:00 hrs.
Salón: B- 4, Plantel 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.

En la red*:* http://estadistica.itam.mx/es/51/contenido/seminario-aleatorio-de-estadistica