El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Medición de los efectos de intervenciones en series de tiempo múltiples sujetas a restricciones lineales: Un ejemplo bancario

será impartida por el

Dr. Víctor M. Guerrero
Departamento de Estadística, ITAM

Resumen

En este trabajo se considera el problema de estimación de los efectos de una intervención sobre un vector de series de tiempo sujeto a una restricción lineal. Se derivan los estimadores lineales e insesgados, de varianza mínima, para dos formulaciones diferentes del problema: (1) Cuando un Análisis de intervención multivariado se realiza y tan solo se requiere un ajuste para satisfacer la restricción. (2) Cuando primero se efecta un Análisis de intervención univariado en la serie agregada que surge de la restricción lineal y después se realiza el Análisis multivariado, cuyos resultados ahora se requiere que sean compatibles con los del Análisis univariado. Un ejemplo de tipo bancario, que dió origen al estudio sirve para ilustrar las soluciones propuestas.

Fecha: ***Viernes 6 de Marzo***
Hora: ***11:15 a 12:30***
Lugar: ***Salón 307, 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.