El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Predicción de Series de Tiempo Económicas no observadas

será impartida por el

Profesor Fabio H. Nieto
Universidad Nacional de Colombia,
Bogotá, Colombia

RESUMEN

En varios países algunas variables macro-económicas no son observadas con la frecuencia requerida por las autoridades económicas para poder hacer Análisis econométrico o para seguir de cerca el crecimiento económico del país. Resulta necesario entonces, estimar estos datos de alta frecuencia, a partir de los datos observados de baja frecuencia. Dos problemas surgen en este contexto, el primero cuando se quiere formar estos estimadores a partir de datos de baja frecuencia y de otros indicadores relacionados y el segundo, cuando sólo se dispone de los datos de baja frecuencia. En esta plática se discutirá una solución óptima del primer problema y un método de solución para el segundo que usa un algoritmo óptimo recursivo. En este último caso se desarrollan adicionalmente pruebas estadísticas para detectar cambios estructurales en las variables involucradas.

Fecha: ***Miércoles 29 de Abril***
Hora: ***16:00 a 17:30***
Lugar: ***Sala de Conferencias, 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.