

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Análisis Bayesiano de Series de Tiempo con Raíces Unitarias y múltiples Cambios Estructurales

será impartida por el

Dr. Enrique de Alba
Director de la División de Estadística, Actuaría y Matemáticas
ITAM

RESUMEN

Se presentan métodos Bayesianos para probar la presencia de raíces unitarias en series de tiempo con múltiples cambios estructurales. La literatura Bayesiana existente considera básicamente un solo cambio estructural, Zivot y Phillips (1994), Maddala y Kim (1996). Desde el punto de vista clásico Bai (1997) y Bai y Perron (1997) presentan métodos para estimar cambios múltiples en los que el momento del cambio se estima endógenamente en forma secuencial; en cada punto se permite la posibilidad de que la serie sufra un cambio de nivel, de pendiente o ambos. Aquí, también se estiman los puntos de cambio en forma endógena y secuencialmente. Esto se hace calculando la probabilidad posterior de 'quiebres' en cada uno de los puntos de la serie; se obtienen condicionando en los puntos que tienen una alta probabilidad de ser cambios estructurales. El primer candidato a ser punto de cambio se determina encontrando el que tiene la más alta probabilidad de serlo (mayor a 0.5). El segundo se obtiene condicionando en el anterior y obteniendo la probabilidad posterior, condicionando en el primero: se elige el que tiene la más alta probabilidad condicional entre los restantes. Este proceso se continua hasta que los puntos restantes tienen todos una baja probabilidad posterior de ser cambio, condicional en los anteriores. Se utilizan previas no-informativas. Se ejemplifican con aplicaciones a series macroeconómicas de México previamente analizadas con métodos clásicos.

Fecha: Viernes 8 de Mayo
Hora: 11.15 a 12:30
Lugar: 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.