

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

ESTIMACIÓN CONJUNTA DE UNA SERIE DE TIEMPO AJUSTADA Y DE SUS EFECTOS DETERMINISTAS LINEALES

será impartida por el

***Dr. Víctor M. Guerrero
Departamento de Estadística
ITAM***

RESUMEN

En esta plática se presenta un método para estimar una serie de tiempo ajustada, simultáneamente con los parámetros de algunos de los efectos lineales deterministas, a menudo presentes en tales series. Tales efectos están básicamente relacionados con variaciones del calendario, observaciones atípicas e intervenciones. El método está diseñado para ser aplicado una vez que se ha construido el modelo incluyendo los efectos deterministas. La serie ajustada se estima simultáneamente con los efectos, lo cual implica reestimar los parámetros de los efectos. La manera óptima de hacerlo es a través del Método de Mínimos Cuadrados con Restricciones, un método estándar que produce estimadores eficientes, pero que a menudo no es implementable. Se sugiere por lo tanto un procedimiento operacional que supera estas dificultades y se establece su eficiencia asintótica. Aunque en la Práctica, el objetivo principal del método propuesto pudiera ser solamente la estimación de la serie, un resultado colateral importante es que los parámetros de los efectos se estiman con una ganancia substancial de eficiencia. Este hecho en sí mismo justifica el uso del método, aún si no se desea estimar la serie ajustada. Con el propósito de medir esta ganancia en eficiencia se introduce y propone el uso de un índice de desglose de la precisión. Se presentan algunos ejemplos teóricos que permiten apreciar el atractivo intuitivo de los resultados. El comportamiento del método en la Práctica se demuestra con dos ejemplos de datos reales.

Fecha: Viernes 26 de febrero

Hora: 12:00

Lugar: Salón 213, 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.