

El Departamento de Estadística del ITAM
dentro de la III Semana de Estadística

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

**Pronsticos restringidos de series temporales económicas
múltiples para el seguimiento de metas por lograr:
el caso de la inflación y el PIB de México**

impartirá

Víctor M. Guerrero¹ (**expositor**), Bernardo Peña², Eva Senra² y Alejandro Alegría¹

¹Departamento de Estadística (ITAM)

²Universidad de Alcalá, ESPAÑA

RESUMEN

En este trabajo se extienden algunos resultados disponibles para las situaciones de pronósticos restringidos, tanto univariados como multivariados. Se considera el seguimiento de las metas simultáneas que puedan existir para algunas variables de carácter económico. Estas variables se supone que forman parte de un vector de series de tiempo para el cual se puede construir un modelo de Vector Autorregresivo con Mecanismo de Corrección del Error. Se propone usar primero una prueba de compatibilidad, para decidir si las metas por lograr son compatibles con el registro histórico de la serie temporal múltiple. Después se incorporan dichas metas económicas como restricciones (ciertas o inciertas) que deben satisfacer los pronósticos. Para obtener la combinación óptima de las restricciones con los pronósticos irrestrictos del modelo de series de tiempo, se hace uso de la técnica de pronósticos restringidos, con la cual se pueden hacer inferencias estadísticas y, en particular, calcular intervalos de predicción. La aplicación empírica considera un modelo de Vector Autorregresivo para seis variables asociadas con la economía mexicana, en el cual se pone énfasis sobre la tasa de inflación en los precios al consumidor y el Producto Interno Bruto.

Fecha Viernes 9 de marzo

Hora: 11:00

Salón: G1

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.