

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Modelos de Series de Tiempo por Mezclas Jerárquicas

impartirá

Gabriel Huerta
área de Probabilidad y estadística
Centro de Investigación en Matemáticas, CIMAT

RESUMEN

El propósito de esta plática es abordar el problema de comparación de modelos y mezcla de modelos para series de tiempo mediante el enfoque conocido como Mezclas Jerárquicas de Expertos (Hierarchical Mixtures-of-Experts). Esta metodología permite elaborar comparaciones de modelos arbitrarios, no necesariamente restringidos a una clase o forma Paramétrica particular. El enfoque es lo suficientemente flexible para incorporar información exógena, que puede estar resumida en términos de covariables o simplemente tiempo, a través de las funciones de peso que definen a la mezcla jerárquica. Se mostrará como estimar los parámetros de dicho modelo mediante el algoritmo E-M y se discutirán algunas de las propiedades teóricas del método en el contexto de modelaje para series de tiempo. Adicionalmente, se presentará un enfoque de estimación totalmente Bayesiano basado en métodos de simulación MCMC. Finalmente, la metodología se ilustrará con el Análisis de dos series de tipo económico y financiero respectivamente.

Fecha: Viernes 26 de abril

Hora: 12:30

Salón: Sala de Video I Biblioteca, 2. Piso

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.