El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Análisis de Cointegración para los Mercados Financieros de América

impartirá

Alejandro Islas Camargo
Departamento de Estadística
ITAM

RESUMEN

Este trabajo presenta un Análisis empírico del grado de integración de los mercados financieros de los seis países más importantes de América Latina, el de Estados Unidos de Norte América de América y Canadá. El Análisis se realizó mediante el uso de datos semanales para el periodo de noviembre de 1989 a junio de 2002, y a través del uso de pruebas de raíces unitarias, cointegración y de un Vector Autoregresivo. Los resultados indican la existencia de una relación de largo plazo entre dichos mercados. Se tomaron tres periodos y grupos de países para estudiar los cambios de la relación de largo plazo a través del tiempo. Finalmente, mediante el uso de la función de impulso y respuesta se estudian los efectos de contagio asociados con impactos a un bloque de pases y a un país en particular.

Fecha: Viernes 29 de Noviembre
Hora: 12:00
Salón: Sala de Video I Biblioteca, 2. Piso

Lista de seminarios próximos. Visite:

www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html

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.