



*El Departamento de Estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión de

***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que con el título

*Sobre un Criterio Predictivo de Selección de Modelos para Series de Tiempo*

Impartirá

**Juan Carlos Martínez Ovando**  
**Banco de México**

**RESUMEN**

En la literatura se han propuesto diferentes criterios para seleccionar modelos estadísticos para series de tiempo. En esta presentación platicaremos sobre la implementación del criterio predictivo M-abierto propuesto por Gutiérrez-Peña y Walker (2001). Este criterio surge de plantear el problema de selección como un problema Bayesiano de decisión, considerando que el objetivo final del análisis es de predicción, y suponiendo fundamentalmente que ninguno de los modelos postulados es el  $\hat{A}$  'verdadero' proceso generador de los datos analizados. Usando una función de utilidad apropiada se tiene que la solución Bayesiana consiste en elegir el modelo cuya distribución predictiva sea más semejante a la de un modelo flexible que aproxime al modelo  $\hat{A}$  'verdadero'. La definición de un modelo flexible para series de tiempo no es una tarea simple. En nuestra implementación empleamos un modelo flexible dentro de una clase de modelos Bayesianos semiparamétricos, en la que los modelos contienen elementos de árboles de Pólya y de onduletas radiales (en general bases radiales) para modelar la parte aleatoria y sistemática de la serie respectivamente. Presentaremos una aplicación de este criterio, y expondremos algunas ventajas y limitaciones que encontramos para su implementación, así como temas para trabajo futuro.

***Fecha: Viernes 1 de Octubre***

***Hora: 12:50 hrs.***

***Salón: Sala de Videos II - 2º. Piso Biblioteca***

**Lista de seminarios próximos. Visite:**

[http://estadistica.itam.mx/seminarios\\_prox.html](http://estadistica.itam.mx/seminarios_prox.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.

María F. Rojano Agraz  
ITAM  
Depto. Académico de Estadística  
Rio Hondo # 1,  
Col. Tizapán San Angel  
C.P. 01000 México, D. F.  
Tel. 5628-4000 ext. 3803  
Fax 5628-4086