



El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 182) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

Pruebas de eficiencia para pronósticos con horizontes múltiples

impartirá

Carlos Capistrán Carmona
Banco de México

Resumen

Este documento desarrolla y analiza una serie de pruebas para evaluar la eficiencia de pronósticos cuando éstos se encuentran disponibles para más de un horizonte. Las pruebas se basan en la propiedad de que la pérdida esperada no condicional de los pronósticos óptimos no debe decrecer con el horizonte de pronóstico (e.g., para el caso de una pérdida cuadrática, la varianza de los errores de un pronóstico óptimo no debe decrecer con el horizonte). Estas pruebas complementan métodos existentes para la evaluación de pronósticos, como lo son las pruebas del tipo Mincer-Zarnowitz, al utilizar una implicación de eficiencia que concierne directamente a pronósticos hechos para distintos horizontes. Se analiza el desempeño de estas pruebas para muestras finitas y se provee un ejemplo empleando la Encuesta de Pronosticadores Profesionales (SPF, por sus siglas en inglés).

Fecha: Viernes 18 de Abril

Hora: 13:00 hrs.

Salón: B-1

Lista de seminarios próximos. Visite:

<http://estadistica.itam.mx/seminarios.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