



El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 193) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

Comparativo de diversos métodos para construir indicadores adelantados para la economía Mexicana

impartirá

Ximena Fernández Martínez
Consultora externa de la OCDE/AIE para la Secretaría de Energía

Resumen

El objetivo de este trabajo fue construir diversos indicadores adelantados para la economía mexicana, con el fin de comparar dichos índices con el obtenido a través de la metodología del NBER. Para ello se utilizaron modelos VAR y modelos de factores dinámicos, específicamente el modelo propuesto por Stock y Watson. El desempeño de los indicadores adelantados fue evaluado con base en el error medio y el error cuadrático medio relativos a una variable objetivo, la cual fue el Índice la Producción Industrial.

Posteriormente, a cada uno de estos índices se les aplicó un modelo de Markov de cambio de régimen para obtener las probabilidades de recesión.

Previo a la construcción de los índices, se analizaron diversas series económicas y financieras, tratando de abarcar todos los sectores de la economía y que representaran en buena medida el comportamiento de la actividad económica. El objetivo del análisis fue clasificar a las series en adelantas, coincidentes o rezagadas. Las técnicas utilizadas para lograr una adecuada clasificación fueron la descomposición de cada una de las series desestacionalizadas en sus diferentes componentes utilizando modelos de componentes no observables. El componente cíclico de las series fue comparado con el de la variable objetivo utilizando correlaciones cruzadas, coherencias y puntos de giro.

Fecha: Viernes 6 de Febrero

Hora: 13:00 hrs.

Salón: B-3

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