

El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 205) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

**Procesos estocásticos: problemas de volatilidad y de datos
agregados**

impartirá

Irma Hernández Magallanes
Statistics Department
University of California, Berkeley**Resumen**

Se presentan dos problemas relacionados con el modelaje de procesos estocásticos: a) modelar la volatilidad y b) modelar datos que presentan diferentes niveles de agregación. Se ilustran estos conceptos y técnicas en el análisis de una serie de tiempo y de un proceso estocástico en el espacio.

Se presenta un análisis de series de tiempo de la demanda de monedas en México. La información es proporcionada por el Banco de México y los datos son analizados en la mínima frecuencia en que se registran (ej. observaciones diarias). La demanda de la denominación de 10 pesos se describe con un proceso ARMAX-GARCH en el dominio del tiempo. En el dominio de la frecuencia se explora el espectro de tercer orden.

El proceso estocástico espacial que se estudia, es el de los incendios ocurridos en Estados Unidos durante el periodo de 1986 a 1997. Los datos fueron proporcionados por el Servicio Forestal de Estados Unidos, quien compiló la información proporcionada por diferentes instituciones. Los datos son registrados en diferentes niveles de agregación y se propone estimar la probabilidad de ocurrencia de un incendio en cada posición a través de un proceso puntual en el espacio.

Fecha: Jueves 17 de Diciembre***Hora: 17:00 hrs.******Salón: B-2*****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