

*El Departamento Académico de Estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión (No. 215) de

***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que, con el título

**Combinaciones de Pronósticos**

impartirá

**Carlos Capistrán Carmona**  
**Banco de México**

**Abstract**

Consideramos combinaciones de pronósticos subjetivos que provienen de encuestas y pronósticos basados en modelos univariados lineales y no-lineales, así como modelos multivariados aumentados con factores. Los resultados empíricos sugieren que un promedio simple de los pronósticos de encuestas tiene un mejor desempeño que el mejor pronóstico basado en modelos para la mayoría de las variables macroeconómicas y horizontes de pronóstico analizados. Mejoras adicionales pueden obtenerse en algunos casos usando un promedio simple de pronósticos de encuestas y pronósticos basados en modelos. También se analiza la importancia de la inestabilidad de los modelos para explicar las ganancias de combinar pronósticos. Resultados analíticos y simulaciones muestran escenarios con cambios estructurales donde las combinaciones de pronósticos tienen un mejor desempeño que los mejores modelos de pronóstico individual.

Palabras Clave: Pronósticos Basados en Factores; Pronósticos No-lineales; Cambios Estructurales; Pronósticos de Encuestas; Pronósticos Univariados.

***Fecha: Viernes 8 de Octubre***

***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