



*El Departamento Académico de Estadística del ITAM*

anuncia la siguiente sesión (No. 227) de

***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que, con el título

**Capacidad predictiva de los índices cíclicos compuestos  
para los  
puntos de giro de la Economía Mexicana**

Impartirá

**Víctor M. Guerrero**

**Dirección de Desarrollo de Modelos Económicos Especiales  
Instituto Nacional de Estadística y Geografía (INEGI)**

y

**Departamento Académico de Estadística**

**Instituto Tecnológico Autónomo de México (ITAM)**

**Resumen**

Este trabajo presenta un análisis de la capacidad predictiva de algunos índices cíclicos para los puntos de giro de la economía mexicana. El enfoque es de ciclo de crecimiento, el cual requiere eliminar la tendencia de las series, por ello se probaron diversos métodos y se determinó que el filtro de Hodrick-Prescott aplicado dos veces es el mejor, en términos de revisiones. Los índices coincidentes y adelantados se estimaron con tres métodos distintos: (1) del NBER, (2) de la OCDE, y (3) de Stock-Watson. Los índices coincidentes producen resultados similares y aceptables, pero los adelantados no brindan resultados satisfactorios.

Palabras clave: Ciclos de crecimiento; estimación de tendencias; filtro de Hodrick-Prescott; indicador adelantado; indicador coincidente.

***Fecha: Viernes 14 de Octubre de 2011***

***Hora: 13:00 hrs.***

***Salón: Salón B-1, Plantel Río Hondo***

**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  
Río Hondo # 1,  
Col. Tizapán San Angel  
C.P. 01000 México, D. F.  
Tel. 5628-4000 ext. 3803  
Fax 5628-4086  
E-mail: mrojano@itam.mx