CANCELADO Seminario 575: Reglas Bayesianas para el Procesamiento Óptimo de información de Modelos Condicionados por Momentos: Teoría y Estimación

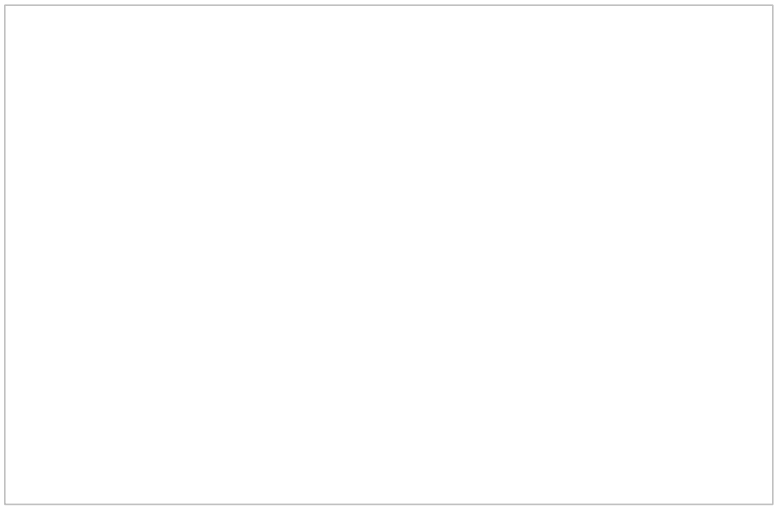
Seminarios y talleres

El seminario semanal de economía es un espacio en el que investigadores nacionales y extranjeros presentan sus trabajos recientes en todas las áreas de economía y finanzas. Se trata de un escenario académico en el que se comunican nuevas metodologías y modelos económicos y financieros y se debaten sus implicaciones de política para Colombia y países de la región.

Informamos que el **Seminario 575: Reglas Bayesianas para el Procesamiento Óptimo de información de Modelos Condicionados por Momentos: Teoría y Estimación** programado para este miércoles 27 de noviembre SE CANCELA.

Resumen del documento: En este artículo se presenta una caracterización completa de cómo implementar el método Bayesiano partiendo de restricciones de momentos. Se muestra que bajo algunas condiciones de regularidad, la solución del criterio de minimización de información Kullback-Leibler (KLIC) es única y la más probable entre todas las soluciones posibles. En la práctica, la solución de KLIC se integra con el muestreo de Monte Carlo Hamiltoniano (HMC) para encontrar el conjunto típico de los parámetros. Este método converge a un único conjunto de parámetros y probabilidad. La verosimilidad marginal se obtiene de la distribución posterior, y se muestra que tiene propiedades asintóticas deseables para estimar pruebas de hipótesis sobre el espacio de probabilidad de las restricciones de momentos. El método se ilustra con algunos ejemplos.

Hora: 12:00 m. (refrigerio) y 12:30 p. m. (inicio del seminario).
Tiempo de exposición: 12:30 p. m. a 1:30 p. m.
Idioma de la exposición: Español



- Imprimir