

[Seminario 582: Reglas Bayesianas para el Procesamiento Óptimo de información de Modelos Condicionados por Momentos](#)

[Seminarios y talleres](#)

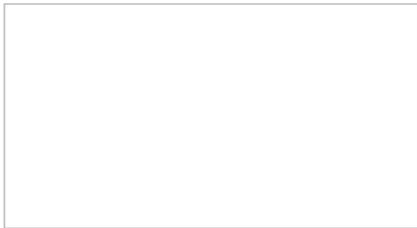
El seminario semanal de economía es un espacio en el que investigadores nacionales y extranjeros presentan sus trabajos recientes en todas las áreas de economía y finanzas. Se trata de un escenario académico en el que se comunican nuevas metodologías y modelos económicos y financieros y se debaten sus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

Resumen del documento: Este artículo presenta un análisis Bayesiano de modelos condicionados por momentos. Bajo ciertas condiciones de regularidad, se muestra que la distribución de probabilidad que se obtiene de la minimización de la distancia Kullback-Leibler es única y la más típica de todas las soluciones posibles. Se introducen métodos formales para evaluar la validez de las restricciones de momentos con el proceso "verdadero" generador de los datos utilizando la verosimilitud marginal. En la práctica, la solución de la minimización de la distancia Kullback-Leibler se complementa con el algoritmo de Monte Carlo Hamiltoniano para encontrar el conjunto típico de los parámetros con los cuales estimar valores esperados. La verosimilitud marginal y los criterios de información se obtienen de las muestras de la distribución posterior, y se muestra que tienen propiedades deseables para pruebas de hipótesis y la comparación de modelos. El método se ilustra con ejemplos simulados y con la estimación de modelos Neo-Keynesianos para la economía de Estados Unidos.

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](#)