El Modelo lineal dinámico para el tratamiento de series temporales: una aplicación numérica

Trabajo fin de máster propuesto por
Prof. Miguel A. Gómez Villegas
Dpto. Estadística e Investigación Operativa

Al menos desde el libro de Carlin & Louis (2008), se sabe que la aproximación bayesiana a los modelos de series temporales permite una modelización más ajustada. Se pretende realizar el planteamiento y escoger un caso práctico que permita realizar la aproximación numérica.

Se comenzará revisando la controversia frecuentista-bayesiana para pasar al tratamiento del modelo normal/normal para pasar a continuación al modelo beta/binomial.

Se pasará al modelo jerárquico para tratar de llegar hasta el tratamiento de las series temporales, si es posible con el modelo lineal dinámico poniendo de manifiesto la aplicabilidad de la aproximación mediante una aplicación numérica.

Bibliografía

–Carlin, B.P. Louis, T.A. (2008) *Bayesian Methods for Data Analysis*. third edition, London: CRC Press.

–Kang, E. L. and Cressie, N. (2011) Bayesian inference for the spacial random effects model, *Journal of the American Statistical Association*, **106**, 495, 972-983.