

ANÁLISIS ESTACIONAL BAYESIANO CON PRIORS ROBUSTOS

Rolando Gonzales Martínez

RESUMEN

Se propone un enfoque Bayesiano para el análisis estacional, utilizando priors robustos para controlar el efecto de observaciones extremas. *Fan charts* estacionales fueron estimados con las densidades predictivas Bayesianas. Se presentan aplicaciones al consumo eléctrico residencial en EE.UU, el turismo en España, y la inflación en Bolivia. Los resultados indican que el enfoque Bayesiano permite investigar probabilísticamente el componente estacional de una serie de tiempo, considerando así la incertidumbre del patrón estacional.

Palabras Clave: Análisis Estacional, Inferencia Bayesiana, Series de Tiempo.