



SILVIA MARY RODRÍGUEZ
COLLAZO

Magíster en Economía

silvia.rodriguez@fcea.edu.uy
<https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/>, www.cinve.org.uy

Fecha de publicación: 01/04/2024
Última actualización: 01/04/2024

Datos Personales

IDENTIDAD

Nombre en citaciones bibliográficas: RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA
Documento: Cédula de identidad - 15010357
Sexo: Femenino
Fecha de nacimiento: 08/12/1966
Lugar de nacimiento: Uruguay / Montevideo / Montevideo
País de Nacionalidad: Uruguay

DIRECCIÓN PERSONAL

Dirección: Paraguay 1011 apto 508 / 11000
País: Uruguay / Montevideo / Montevideo
Teléfono: (598) 29035893
Correo electrónico: silvia.rodriguez@fcea.edu.uy

Datos Generales

INSTITUCIÓN PRINCIPAL

Universidad de la República/ Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Instituto de Estadística / Uruguay

DIRECCIÓN INSTITUCIONAL

Institución: Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Sector Educación Superior/Público
Dirección: Eduardo Acevedo 1139 / 11200
País: Uruguay / Montevideo / Montevideo
Teléfono: (0598) 24102564
Correo electrónico/Sitio Web: silvia@iesta.edu.uy www.iesta.edu.uy

Formación

Formación académica

CONCLUIDA

MAESTRÍA

Maestría en Economía (2018 - 2023)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Título de la disertación/tesis/defensa: Incertidumbre en las estimaciones en tiempo real de brecha de producto. Implicaciones para el ajuste cíclico del déficit fiscal.
Tutor/es: Fernando Lorenzo y Bibiana Lanzilotta
Descripción del título obtenido: Magister en Economía
Obtención del título: 2023
Palabras Clave: Política Fiscal Fluctuaciones Macroeconómicas Reglas Fiscales Brecha de producto Crecimiento subyacente Estimaciones en tiempo real Incertidumbre REvisión de estimaciones Componentes no observables
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series temporales

GRADO

Economista (1985 - 1993)

Universidad de la República - Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Título de la disertación/tesis/defensa:
Obtención del título: 1993
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Formación complementaria

CONCLUIDA

CURSOS DE CORTA DURACIÓN

Economía Laboral (01/2001 - 01/2001)

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
40 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía Laboral

Curso Taller de métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura (01/2000 - 01/2000)

Sector Empresas/Privado / Empresa Privada / Centro de Investigaciones Económicas , Uruguay
60 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura Económica

Análisis Exploratorio de las Series Temporales (01/1997 - 01/1997)

Sector Extranjero/Internacional/Otros / Programme de Recherche et d Enseignement en Statistique Appliquée , Francia
10 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Tópicos de econometría (01/1997 - 01/1997)

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Sociales , Uruguay
50 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Métodos cuantitativos avanzados -Opción econometría (01/1996 - 01/1996)

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
70 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Curso-Taller Interamericano sobre Métodos Estadísticos Aplicados a la Investigación Social (01/1995 - 01/1995)

Sector Extranjero/Internacional/Otros / Centro Interamericano de Enseñanza de Estadística , Chile
35 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Métodos cuantitativos

Análisis Multivariado de datos (01/1994 - 01/1994)

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
85 horas
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Métodos cuantitativos

Teoría y Método de la Historia Económica (01/1993 - 01/1993)

Sector Extranjero/Internacional/Otros / Universidad de Gotemburgo , Suecia

60 horas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Otras Ciencias Sociales / Ciencias Sociales Interdisciplinarias / Historia Económica

Historia Económica (01/1993 - 01/1993)

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Sociales , Uruguay

70 horas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Otras Ciencias Sociales / Ciencias Sociales Interdisciplinarias / Historia Económica

PARTICIPACIÓN EN EVENTOS

"La escritura en la Universidad:tutoría de trabajos finales de grado" (2017)

Tipo: Taller

Institución organizadora: Comisión Sectorial de Enseñanza. Udelar, Uruguay

Palabras Clave: educación superior escritura en disciplinas

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Ciencias de la Educación / Educación General /

Idiomas

Inglés

Entiende bien / Habla regular / Lee bien / Escribe regular

Áreas de actuación

CIENCIAS SOCIALES

Economía y Negocios /Economía, Econometría /Métodos Cuantitativos Series Temporales

CIENCIAS SOCIALES

Economía y Negocios /Economía, Econometría /Predicción Macroeconómica

CIENCIAS SOCIALES

Economía y Negocios /Economía, Econometría /Análisis de Coyuntura y Predicción

Actuación profesional

SECTOR EDUCACIÓN SUPERIOR/PÚBLICO - UNIVERSIDAD DE LA REPÚBLICA - URUGUAY

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Instituto de Estadística. Departamento de Métodos Cuantitativos

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (06/2013 - a la fecha) Trabajo relevante

Profesor Agregado 40 horas semanales

Instituto de Estadística. Equipo de Series de tiempo.Desde 2003 coordinadora y responsable del equipo de investigación y del curso Series Temporales de la Licenciatura de Estadística de la Facultad de Ciencias Económicas.

Escalafón: Docente

Grado: Grado 4

Cargo: Efectivo

Funcionario/Empleado (10/2001 - 06/2013)

Profesor adjunto 40 horas semanales

Instituto de Estadística. Equipo de Series de tiempo. Desde 2003, coordinadora y responsable del equipo y del curso Series Temporales I de la Licenciatura de Estadística de la Facultad de Ciencias Económicas.

Escalafón: Docente

Grado: Grado 3

Cargo: Efectivo

Funcionario/Empleado (04/1997 - 04/2006)

Asistente de investigación, Inst. Economía 20 horas semanales

Instituto de Economía, Equipo de empleo e ingresos

Escalafón: Docente

Grado: Grado 2

Cargo: Interino

Funcionario/Empleado (04/1996 - 03/2001)

Asistente de investigación 30 horas semanales

Instituto de Estadística, Equipo: Series de Tiempo

Escalafón: Docente

Grado: Grado 2

Cargo: Interino

Funcionario/Empleado (04/1992 - 03/1996)

Ayudante de investigación 20 horas semanales

Instituto de Estadística. Equipo: Análisis multivariado de datos y posteriormente Series temporales

Escalafón: Docente

Grado: Grado 1

Cargo: Interino

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Análisis y modelización de series temporales de alta frecuencia (03/2006 - a la fecha)

El objetivo es analizar y modelizar las características específicas de las series de alta frecuencia, en especial de frecuencia diaria. Esto implica poner acento en la modelización de aspectos como el efecto calendario en aplicaciones como la venta de boletos de la terminal tres cruces, las llamadas entrantes a un call center. Aspectos relevantes como la modelización de las estacionalidades múltiples, la incidencia de variables climáticas en el caso de la demanda de energía, son algunos ejemplos donde los énfasis de la modelización varían de acuerdo a la aplicación específica. Dentro de esta línea se han desarrollado varios proyectos que cubren los aspectos antes mencionados.

5 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística, Coordinador o Responsable

Equipo: RODRÍGUEZ, S.

Palabras clave: modelización univariada alta frecuencia demanda de energía eléctrica efecto calendario

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría de series de tiempo

Incertidumbre y medición del PIB. Revisión en los datos de Cuentas Nacionales (05/2016 - a la fecha)

La estimación y cálculo de los indicadores que son parte de las Cuentas Nacionales se realizan a partir de datos que provienen de distintas fuentes, censos económicos, registros administrativos, información contable de las empresas, encuestas por muestreo, entre otras. No todas estas fuentes tienen la misma periodicidad, algunas son mensuales otras trimestrales, incluso anuales. El Banco Central del Uruguay (BCU) realiza revisiones periódicas en los datos, las más importantes en cuanto a magnitud se dan en el último trimestre del año cuando se actualiza la información que se obtiene anualmente. Pero el BCU no publica la base de datos en las que se incluyen las series publicadas por trimestre, de modo de que el público cuente con las diferentes versiones, por lo que para analizar las revisiones es necesario crear la base de datos. Cuando se realizan proyecciones sobre la trayectoria futura de una variable como el Producto Bruto Interno (PIB) se parte de la última serie disponible. Cuando la serie se revisa, las predicciones se basan en una trayectoria

pasada que puede ser muy diferente a la revisada. Los datos pueden verse modificados por revisiones sucesivas sobre el mismo dato hasta que el dato se convierte en definitivo. Por tanto la incertidumbre está presente tanto en los valores pasados como en los futuros del PIB. En una sintética descomposición de los errores de predicción, se pueden ubicar algunos componentes como los errores provenientes de la especificación y estimación del modelo, los errores en que se incurre debido a los choques imprevistos, los asociados a errores de predicción en las variables exógenas si las hubiera, a los que se suman los errores que se generan al predecir la trayectoria futura a partir de datos preliminares. El objetivo de esta línea es avanzar en la caracterización de las revisiones en el Índice de Volumen Físico del Producto Bruto Interno agregado.

Aplicada

10 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística, Coordinador o Responsable

Equipo:

Palabras clave: revisión de los datos, data vintages, PIBtendencias comunes predicción extracción de señales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura y Predicción

Estimación de la posición cíclica de la economía urugaya mediante la aplicación de filtros y modelos (03/2020 - a la fecha)

La nueva institucionalidad fiscal incluye un conjunto de reglas numéricas, algunas de las cuales están asociadas a componentes no observables como el producto potencial y la brecha de producto. En ese marco resurge la necesidad de estimar la posición cíclica de la economía y obtener estimaciones periódicas de crecimiento potencial y ciclo. La identificación y estimación de componentes no observables ha sido un tema largamente estudiado aunque no se ha llegado a un consenso sobre cuál es el mejor método para estimarlos, la extracción de la tendencia y la señal cíclica mediante filtros univariados es una alternativa metodológica muy utilizada. El tipo de diseño de las reglas numéricas estrechamente vinculadas a las estimaciones de la posición cíclica y el crecimiento potencial, trae consigo las dificultades metodológicas asociadas a los métodos que se aplican. Un aspecto relevante tiene que ver con las revisiones en las estimaciones. Cuando se incorpora nueva información, las nuevas estimaciones difieren de las anteriores, en algunas metodologías las mayores diferencias se concentran al final de la muestra, lo que contribuye a incrementar la incertidumbre asociada a las estimaciones. Las decisiones de política fiscal de acuerdo a esta regla se toman en el momento t y se aplican en el momento $t+1$, por tanto al momento de decidir el tope de gastos o la corrección a realizar al balance fiscal, la señal cíclica y el producto potencial podrán ser diferentes al momento cuando se les estimó. Si las diferencias (revisiones) son pronunciadas, podrá implicar divergencias en las decisiones en uno y otro momento del tiempo. En esta línea de trabajo se exploran diversas metodologías para aproximar la señal cíclica.

Aplicada

15 horas semanales, Coordinador o Responsable

Equipo: RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Palabras clave: Brecha de producto señal cíclica

Análisis, modelización y predicción de variables económicas (04/2014 - a la fecha)

Esta línea cubre diversos aspectos y sub líneas de investigación a lo largo del tiempo ha cubierto diversos aspectos metodológicos, con énfasis en la frecuencia de los datos, la predicción, la modelización no lineal, la estimación de componentes no observables, el análisis y aplicación de diversos filtros con el objetivo de obtener estimaciones de los distintos componentes de las series de interés de acuerdo a cuál es la señal relevante en cada caso.

5 horas semanales, Integrante del equipo

Equipo: RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series Temporales

Relación de largo plazo entre crecimiento y transporte aéreo para cuatro países del Cono Sur (03/2016 - 12/2016)

Esta línea de trabajo está creada con el fin de estudiar y delimitar el tipo de relación dinámica que existe entre el transporte aéreo y el crecimiento económico en cuatro países Argentina, Brasil, Chile y Uruguay, sin imponer a priori ningún modelo paramétrico para representarla. La literatura ha analizado de diversas formas y metodologías la relación entre los sectores transables y el

crecimiento económico. Estudios recientes sobre la hipótesis de crecimiento impulsado por actividades transables que fueron desarrollados dentro de un marco metodológico no paramétrico introdujeron una nueva perspectiva para abordar esta cuestión. La introducción de la posibilidad de que los vínculos entre las variables económicas no sean necesariamente lineales evita restringir el análisis empírico y amplía la gama de tipologías de vínculos entre las variables económicas. En algunos casos, los métodos de contraste pueden llevar a rechazar la hipótesis de no linealidad, pero en otros no. Se sigue la metodología propuesta en Brida et al (2015), que adapta la metodología propuesta en Ye Lim et al (2011), aplicada a datos anuales de PIB per cápita y el número de pasajeros aéreos para el período 1970-2015 de esos cuatro países. El tipo de cambio real se introduce con el fin de tener capturar el efecto de los precios. En primer término, contrasta la existencia de una relación de cointegración entre las variables, identificando si el modelo subyacente es lineal o no. Adicionalmente, se implementa una prueba de causalidad no paramétrica para identificar la dirección causal (unidireccional o bidireccional) entre las variables que permite concluir para cada país si la evolución del sector mejora el crecimiento económico, si es este último el que da impulso al desarrollo del transporte, o, alternativamente, existe una influencia bilateral.

Aplicada

4 horas semanales

Departamento de Métodos Cuantitativos, Instituto de Estadística, Integrante del equipo

Equipo: RODRÍGUEZ, S., BRIDA GABRIEL, LANZILOTTA BIBIANA, ZAPATA AGUIRRE SANDRA

Palabras clave: transporte aéreo cointegración lineal y no lineal test de causalidad no paramétrica

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos dinámicos

Modelos de series de tiempo de alta frecuencia (diaria y horaria) con fuerte patrón estacional (02/2013 - 06/2016)

Esta línea de investigación tiene por objeto recorrer diferentes aproximaciones metodológicas para la modelización de series temporales a series de frecuencia horaria. Se centrará el análisis en la demanda de energía eléctrica. La modelización estará orientada a obtener predicciones de su dinámica en el corto plazo. El tipo de modelos a seleccionar (de series temporales) se encuentran muy vinculados a la frecuencia con que se obtienen las observaciones. El hecho que las observaciones se registren cada día, cada hora o cada media hora o incluso en intervalos de tiempo menores como por minuto, preselecciona el tipo de modelos con los que trabajar. Los modelos adecuados para captar las periodicidades más relevantes, en especial en lo que refiere por ejemplo a la modelización de la demanda horaria de energía eléctrica, debe contemplar la existencia de diferentes estacionalidades, el peso que tienen en la dinámica de la serie los días especiales, fines de semana, feriados, vacaciones, etc. Hay una variedad de aplicaciones donde se pueden encontrar estas particularidades, como por ejemplo y sin que el listado sea exhaustivo, cuando el propósito es modelizar la demanda de energía eléctrica, la demanda de agua, la trayectoria de los precios spot de la energía eléctrica, generación de energía eólica, número de llamadas que llegan a un, tráfico de llamadas de teléfonos celulares para determinada zona a determinada hora, entre otras. En esta línea de trabajo se hará especial énfasis en la modelización y predicción del comportamiento de la demanda de energía eléctrica de Uruguay.

Aplicada

15 horas semanales

Instituto de Estadística, Coordinador o Responsable

Equipo: MASSA, F.

Palabras clave: estadística aplicada, jóvenes investigadores estacionalidad intradiaria series de alta frecuencia

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Relación de largo plazo entre el crecimiento económico y el sector transporte aéreo de pasajeros en México (03/2014 - 03/2016)

El transporte aéreo estimula el crecimiento económico, o si el desarrollo del sector viene asociado al crecimiento económico? incluso es posible plantearse la hipótesis que existe una suerte de retroalimentación entre crecimiento económico y desarrollo del sector transporte aéreo. Los efectos positivos del desarrollo del transporte aéreo en el crecimiento económico se pueden observar a través de diversos canales. Se pretende generar evidencia respecto a tres posibles vínculos entre el crecimiento económico y el desarrollo del transporte aéreo de pasajeros. Mediante la aplicación de técnicas lineales y no lineales se contrasta la hipótesis de la existencia de una relación de largo plazo entre crecimiento económico y transporte aéreo de pasajeros y se explora la dirección en que se da este vínculo. Si el transporte aéreo impulsa el crecimiento económico o la expansión económica impulsa el crecimiento del sector transporte aéreo de pasajeros, o si existe una relación bidireccional. A los efectos de explorar el vínculo entre el PIB real

de México y el número de pasajeros transportados por vía aérea para el período 1995 - 2013 se realizan pruebas de cointegración y causalidad no paramétricas.

Aplicada

5 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Integrante del equipo

Equipo: LANZILOTTA,B. , BRIDA,GABRIEL , BRINDIS-RODRIGUEZ MARTÍN

Palabras clave: test de causalidad no paramétrica cointegración no lineal

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Dinámica Económica

Modelización y análisis econométrico de series de tiempo con componente estacional relevante (09/2011 - 12/2012)

Esta línea de investigación tuvo como objeto la caracterización de la estacionalidad de un conjunto de series económicas, mediante la aplicación de un conjunto de contrastes que permitirían diferenciar aquellas series que presentan un patrón estacional estable de las que siguen un patrón evolutivo. Con tal finalidad se aplicaron dos tipos contrastes de raíces unitarias estacionales , el propuesto por Hylleberg,Engle,Granger y Yoo (HEGY 1990) , Canova-Hansen (C-H 1995). Ambos tests son complementarios. La hipótesis nula del primero de ellos postula la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales, mientras que el segundo parte del supuesto de que los ciclos estacionales son determinísticos. Adicionalmente se analizan otras variantes de los test originalmente considerados , permitiendo la existencia de quiebres o cambios en el patrón estacional . Esto permite aplicar otra versión del test creada por Franses (1997) en el que se introduce en la especificación del test HEGY un quiebre en la medias estacionales. Se comparan los resultados al introducir como regresor en el test C-H también un quiebre en las medias estacionales. El cambio metodológico juega un papel fundamental en lo que a la caracterización de la estacionalidad de la serie se refiere. La incorporación del quiebre tiene como efecto en la aplicación estudiada la convergencia en los resultados de los test HEGY y CH así como en la clasificación del patrón estacional.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Coordinador o

Responsable

Equipo: MASSA,F.

Palabras clave: Estacionalidad, Turismo , HEGY, Canova-Hansen Estacionalidad evolutiva. HEGY, Canova Hansen raíces unitarias estaciones

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

Modelización de demanda de combustibles (02/2009 - 07/2011)

En el marco del Programa de vinculación ANCAP-UdelaR se desarrolló de un Convenio entre el IESTA y ANCAP se desarrollaron un conjunto de modelos de predicción de corto plazo, tanto univariados (ARIMA-IA) como multivariados (VAR,VEC) de demanda de combustibles líquidos y gas licuado de petróleo. En una segunda etapa del proyecto, a solicitud de ANCAP se elaboró un programa informático que reprodujera un modelo de proyección de demanda de largo plazo de diferentes energéticos, agregados tanto por producto como por sector de actividad.

30 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Coordinador o Responsable

Equipo: GONZALEZ,G , URRESTARAZU, I. , MASSA,F , RODRÍGUEZ,S. , NALBARTE,L. , DA SILVA,N.

Palabras clave: modelos de demanda combustibles, ARIMA, VEC,VAR

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción

Producto potencial y brecha de producto en Uruguay (06/2007 - 12/2008)

Los análisis vinculados a la estimación de los componentes no observables, tendencia, ciclo, estacional e irregular se han implementado con frecuencia mediante tres tipos de metodologías, una, frecuentemente utilizada (X-12 ARIMA), clasificada como empiricista y las otras dos, se clasifican dentro de lo que se conoce como métodos de los modelos, en los que se estiman modelos específicos para los componentes. En el método basado en modelos (Maravall 1987) el componente tendencia y el componente ciclo se estiman conjuntamente. Existe una variedad de métodos para separar esos componentes. Se realiza un relevamiento y análisis de diferentes filtros cuya aplicación da lugar a estimaciones separadas de los componentes. Se presta especial atención a los filtros de Butterworth, en particular el filtro de Hodrick- Prescott (1980), el filtro pasabanda

de Baxter y King (1995) y el filtro de Christiano y Fitzgerald (1999).

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Coordinador o Responsable

Equipo: RODRÍGUEZ,S., ALVAREZ,I. , DA SILVA,N.

Palabras clave: filtros lineales, brecha de producto

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Modelización estocástica y predicción de la evolución del número de personas privadas de libertad (04/2006 - 08/2007)

Se aplicó la modelización ARIMA-IA y la modelización de los componentes inobservables a la serie mensual de personas privadas de libertad con el objetivo de caracterizar el comportamiento y evolución de la serie así como predecir la evolución futura de la misma.

10 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Integrante del equipo

Equipo: RODRÍGUEZ,S. , NALBARTE,L.

Palabras clave: extracción de señales,ARIMA evolución personas privadas de libertad Uruguay

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Econometría de series de tiempo

Modelización del Índice de precios para Montevideo de los Hogares de menores ingresos (IESTA) (07/2004 - 12/2005)

Se inicia el proceso de modelización mediante modelos ARIMA-IA univariados aplicado a la serie del Índice de Precios al Consumo de los hogares de menores ingresos, índice mensual elaborado por el IESTA. En una segunda etapa se estudia y aplica los modelos autorregresivos de heteroscedasticidad condicional (ARCH) y los modelos generalizados autorregresivos de heteroscedasticidad condicional (GARCH), a los efectos de modelizar la varianza incondicional del índice.

10 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Coordinador o Responsable

Equipo: BADAGIÁN, A.L. , CILINTANO,S.

Palabras clave: ARCH,GARCH

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Econometría de series de tiempo

Dinámicas no lineales y ciclos asimétricos (02/2003 - 06/2004)

El objetivo de esta investigación fue contrastar la presencia de comportamientos asimétricos de tipo longitudinal y transversal del ciclo económico, mediante la variable IVF del PIB. Para ello se seleccionó el test Triples de Randles, Flinger, Policello y Wolfe (1980). Este test se aplicó a las variables, Producto Bruto Interno de Uruguay, Argentina y Brasil y Tasa de desempleo de Uruguay. El estudio incluyó un análisis de sensibilidad de los resultados de acuerdo a la metodología utilizada para estimar el ciclo.

31 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Coordinador o Responsable

Equipo: BADAGIÁN, A.L. , RODRÍGUEZ,S.

Palabras clave: asimetrías en el ciclo, test Triples

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Grado de integración de la tasa de desempleo (10/2001 - 12/2002)

En esta línea de investigación se aplican un conjunto de test de raíces unitarias y de tendencias segmentadas con el objeto de analizar el fenómeno de persistencia en la tasa de desempleo en Uruguay. Para ello se realiza un análisis empírico aplicado a la serie tasa de desempleo de Montevideo.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Integrante del equipo

Equipo: SELVES,R. , BADAGIÁN, A.L. , GOYENECHE,J.J. , RODRÍGUEZ,S.

Palabras clave: quiebres,test raíz unitaria

Areas de conocimiento:

Raíces unitarias y tendencias segmentadas (02/1998 - 07/1999)

Durante el desarrollo de este proyecto se analizó la dinámica de los tipos de cambio reales bilaterales de Argentina, Brasil, Uruguay y Estados Unidos mediante la aplicación de un conjunto amplio de test de raíces unitarias regulares, estacionales y de tendencia segmentada. Adicionalmente se estudió el cumplimiento de la paridad de poderes de compra (PPC) entre Argentina, Brasil y Uruguay y de estos países con Estados Unidos para el período 1913-1997, con series anuales y 1973 a 1998 con datos trimestrales.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística , Integrante del equipo
Equipo: RODRÍGUEZ, S., GROSSKOFF, R., FERNÁNDEZ, A., DAUDE, C., SAPRIZA, H.

Palabras clave: PPP, test raíz unitaria

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN Y DESARROLLO

Modelos de series de tiempo de alta frecuencia con fuerte patrón estacional (02/2013 - 12/2016)

El objetivo del proyecto consiste en la aplicación y comparación de diferentes metodologías de modelización de series temporales a series de frecuencia horaria con el objetivo de predecir su dinámica en la hora siguiente y hasta las próximas 24 horas. Estas series se ven caracterizadas por la alta frecuencia con la que se registran los datos. El enfoque de series temporales y las metodologías a aplicar en los diferentes estudios empíricos se encuentra muy vinculada a la frecuencia con que se obtienen las observaciones. El hecho que las observaciones se registren cada día, cada hora o cada media hora o incluso en intervalos de tiempo menores como por minuto, preselecciona el tipo de modelos con los que trabajar. Los modelos adecuados para captar las periodicidades más relevantes, en especial en lo que refiere por ejemplo a la modelización de la demanda horaria de energía eléctrica, debe contemplar la existencia de diferentes estacionalidades, el peso que tienen en la dinámica de la serie los días especiales, fines de semana, feriados, vacaciones, etc. Hay una variedad de aplicaciones donde se pueden encontrar estas particularidades, como por ejemplo y sin que el listado sea exhaustivo, cuando el propósito es modelizar la demanda de energía eléctrica, la demanda de agua, la trayectoria de los precios spot de la energía eléctrica, generación de energía eólica, número de llamadas que llegan a un, tráfico de llamadas de teléfonos celulares para determinada zona a determinada hora, entre otras. Dentro del proyecto está propuesto estimar y predecir la demanda de energía eléctrica de Uruguay lo largo del día sobre la base de un único modelo SARIMA con estacionalidades múltiples, incluyendo variables de regresión que recojan el efecto calendario como las intervenciones y posibles puntos anómalos existentes. Adicionalmente se incluirá una estrategia de modelización alternativa, estimando y proyectando la demanda por hora y a lo largo del día de energía de Uruguay, mediante 24 modelos, uno para cada hora del día. Finalmente se realizará un análisis comparativo de los resultados en términos de desempeño predictivo de las alternativas antes mencionadas. En el marco de este proyecto se realizan tareas de formación a estudiantes en el marco del programa de iniciación a la investigación. El proyecto comprende objetivos específicos así como la exploración y estudio de nuevas metodologías de modelización.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC , Instituto de Estadística
Investigación

Coordinador o Responsable

Concluido

Equipo: MASSA, F.

Palabras clave: Predicción, energía eléctrica, demanda horaria series de alta frecuencia
modelización series horarias

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Caracterización de la estacionalidad de los componentes del Producto de Uruguay (09/2011 - 12/2012)

Este proyecto tuvo como objeto la caracterización de la estacionalidad de un conjunto de series económicas, mediante la aplicación de un conjunto de contrastes con el objeto de diferenciar aquellas series que presentan un patrón estacional estable de las que siguen un patrón evolutivo. Con tal finalidad se aplicaron dos tipos contrastes de raíces unitarias estacionales, el propuesto por Hylleberg, Engle, Granger y Yoo (HEGY 1990), Canova-Hansen (C-H 1995). Ambos tests son complementarios. La hipótesis nula del primero de ellos postula la existencia de raíces unitarias en

las frecuencias estacionales, mientras que el segundo parte del supuesto de que los ciclos estacionarios son determinísticos. La aplicación seleccionada consistió en caracterizar la estacionalidad de los componentes del producto bruto interno de Uruguay (IVF PBIU), desagregados por componentes del gasto y por industrias. Dado el cambio metodológico que se implementó en las Cuentas Nacionales en 2005 se plantea la hipótesis de la existencia de un cambio en la estacionalidad de las series estudiadas. Esto permite aplicar otra versión del test creada por Franses (1997). En esta versión se introduce en la especificación del test HEGY un quiebre en las medias estacionales y se observan los cambios en los resultados de los contrastes. En el desarrollo de la aplicación también se introduce en el test C-H un quiebre en las medias estacionales. El cambio metodológico juega un papel fundamental en lo que a la caracterización de la estacionalidad de la serie se refiere. La incorporación del quiebre representando el cambiometodológico tiene como efecto la convergencia en los resultados de los test HEGY y CH y por en la clasificación del patrón estacional.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración , Instituto de Estadística

Investigación

Coordinador o Responsable

Concluido

Equipo: MASSA,F.

Palabras clave: Estacionalidad, Turismo , HEGY, Canova-Hansen

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

Modelos de predicción de la demanda de combustibles líquidos y supergas (05/2009 - 07/2011)

La primer etapa del proyecto tuvo dos objetivos principales: el primero es diseñar un conjunto de modelos de predicción , tanto univariados como multivariados para la demanda de combustibles como gasoil, fueloil, naftas y supergas y el segundo transferir los resultados de esta investigación y capacitar al personal de ANCAP para utilizar y actualizar los modelos elaborados. La segunda etapa del proyecto estuvo dirigida a la programación en R de un conjunto de escenarios acerca de la dinámica de largo plazo de la demanda de combustibles de ANCAP. El programa fue creado en el IESTA, el diseño de los escenarios fue provisto por ANCAP.

30 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración , Instituto de Estadística

Investigación

Coordinador o Responsable

En Marcha

Equipo: URRESTARAZU, I. , GONZALEZ,G , MASSA,F , DA SILVA,N. , NALBARTE,L. (Responsable) , RODRÍGUEZ,S. (Responsable)

Palabras clave: modelos de demanda combustibles, ARIMA, VEC,VAR

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción

Modelización y estimación del producto potencial y brecha de producto en Uruguay (06/2007 - 12/2008)

El objetivo de esta investigación es estimar la brecha de producto en Uruguay mediante un enfoque univariado. En particular se aplica un conjunto de filtros a la serie de Índice de Volumen Físico del Producto Bruto Interno de Uruguay y se obtienen diversas estimaciones de brecha de producto A partir del componente tendencia-ciclo estimado mediante dos métodos de descomposición (método de los modelos(AMB) y X-12 ARIMA), se desagrega el componente tendencia-ciclo mediante la aplicación del filtro Hodrick- Prescott, Baxter y King (1995) y el filtro diseñado por Christiano y Fitzgerald (1999), dos filtros de los denominados filtros pasa banda.

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración , Instituto de Estadística

Investigación

Concluido

Equipo: ALVAREZ, I. , DA SILVA,N. , RODRÍGUEZ,S. (Responsable)

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

Exportaciones Agropecuarias y agroindustriales: predicciones de corto plazo (03/2005 - 12/2007)

El objetivo fundamental del proyecto era evaluar la capacidad predictiva de los modelos ARIMA

univariados para estimar el comportamiento futuro de las exportaciones agropecuarias y agroindustriales. El proyecto incluyó tres etapas, la formación del equipo, la selección del tipo de desagregación a realizar para aplicar la metodología y finalmente la modelización, predicción y estimación de los componentes no observables de las series.

12 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística-Instituto de Economía
Desarrollo

Integrante del Equipo

Concluido

Financiación:

Comisión Sectorial de Investigación Científica, Uruguay, Remuneración

Equipo: SALAZAR, A., OLMOS, L., ALFARO, D., FAILDE, A. (Responsable)

Palabras clave: ARIMA models, non observed components

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría de series de tiempo

Empleo y desempleo: perspectivas a corto, mediano y largo plazo (06/1997 - 12/1999)

20 horas semanales

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Economía

Desarrollo

Integrante del Equipo

Concluido

Financiación:

Comisión Sectorial de Investigación Científica, Uruguay, Apoyo financiero

Equipo: AMARANTE, V., CHABALGOITY, S., GLMÉS, M. (Responsable), NOTARO, J. (Responsable)

Palabras clave: predicciones, empleo

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Economía del trabajo

DIRECCIÓN Y ADMINISTRACIÓN

Equipo de Dirección (06/2019 - 08/2023)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. IESTA

3 horas semanales

(03/2005 - 12/2013)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin., Instituto de Estadística (IESTA)

4 horas semanales

DOCENCIA

Licenciatura en Estadística (03/1999 - a la fecha)

Grado

Responsable

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelización univariada

Maestría en Economía (04/2005 - 06/2019)

Maestría

Invitado

Asignaturas:

Paquetes estadísticos aplicados a la economía, 10 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría

Maestría en Economía (08/2015 - 08/2018)

Maestría

Asistente

Asignaturas:

Tópicos de Econometría - Series Temporales, 4 horas, Teórico-Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de demanda de energéticos

Maestría en Economía (06/2015 - 08/2017)

Maestría

Responsable

Asignaturas:

Econometría, 6 horas, Teórico-Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de demanda de energéticos

Maestría en Economía (08/2010 - 08/2014)

Maestría

Asistente

Asignaturas:

Series Temporales, 6 horas, Teórico-Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelización univariada y multivariada de series temporales, extracción de señales

Maestría en Economía (08/2011 - 08/2014)

Maestría

Responsable

Asignaturas:

Métodos Cuantitativos Opción Econometría, 9 horas, Teórico-Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelización univariada y multivariada de series temporales, extracción de señales

Licenciatura en Economía (04/2003 - 03/2005)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Econometría I y II, 8 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría

Licenciatura en Economía (04/1997 - 12/1999)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Economía Descriptiva I, 8 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía

Licenciatura en Economía (04/1992 - 04/1996)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Economía II, 8 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Macroeconomía

Licenciatura en Economía (04/1991 - 12/1993)

Grado

Asistente

Asignaturas:

Economía Descriptiva I, 8 horas, Práctico

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía

CAPACITACIÓN/ENTRENAMIENTOS DICTADOS

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC, Instituto de Estadística (06/2014 - 06/2014)

Curso de capacitación en el uso de modelos de predicción para la demanda de GLP
6 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura y Predicción

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción de demanda

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC, Instituto de Estadística (11/2013 - 12/2013)

Extracción de señales, Modelización de componentes no observables en series financieras
6 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción macroeconómica

SERVICIO TÉCNICO ESPECIALIZADO

(07/2010 - 11/2010)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC, Instituto de Estadística
10 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción de demanda

(06/2009 - 12/2009)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC, Instituto de Estadística
10 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción de demanda

GESTIÓN ACADÉMICA

Coordinación de la Unidad Académica Métodos en Economía. Departamento de Métodos Cuantitativos (06/2018 - 12/2022)

UNidad Académica Métodos en Economía
Gestión de la Enseñanza 12 horas semanales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Gestión de Enseñanza

Integrante de la Comisión de seguimiento del Plan Estratégico del IESTA (08/2017 - 12/2020)

Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Instituto de Estadística
Participación en consejos y comisiones

Paere del equipo organizador de las actividades académicas a realizar por el Prof. Visitante Antoni Espasa (05/2015 - 12/2015)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC
Otros

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Parte del comité organizador de las Jornadas Académicas 2014 de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (06/2014 - 09/2014)

Facultad de Ciencias Económicas y Administración
Otros

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Integrante de la Comisión de Claustro-Plan de Estudios 2014 de la Licenciatura de Estadística (04/2014 - 08/2014)

Facultad de Ciencias Económicas y Admin. Depto MMC

Participación en consejos y comisiones

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

SECTOR EMPRESAS/PRIVADO - EMPRESA PRIVADA - URUGUAY

Centro de Investigaciones Económicas

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (12/2011 - a la fecha) Trabajo relevante

Investigador Asociado 10 horas semanales

Funcionario/Empleado (08/2010 - 08/2019)

Docente 2 horas semanales

Curso: Análisis de series temporales y técnicas de predicción

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Modelización y proyección de la actividad del sector industrial en Uruguay. (12/2011 - a la fecha)

Esta línea comprende la modelización y la predicción de la actividad del sector industrial, en ese marco se desarrollan análisis y estudios e informes de coyuntura periódicos del sector, tanto en forma agregada como desagregado por grupos o conjuntos de ramas.

Aplicada

5 horas semanales

CINVE , Coordinador o Responsable

Equipo: ROSICH,LUCÍA , RODRÍGUEZ EUGENIA

Palabras clave: sector industrial Uruguay Modelización actividad industrial Predicción de la actividad industrial

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura y Predicción

Predicción de demanda de energía (02/2012 - a la fecha)

Estudios realizados en el marco de proyectos de investigación y consultorías contratadas

Comprende la modelización y predicción de la demanda de energía eléctrica en Uruguay, considerando datos de frecuencia, trimestral, mensual, diaria y horaria. En el marco de esta línea se han realizado consultorías a UTE, como proyectos de investigación realizados con fondos concursables de ANII. Esta línea de investigación continua.

Aplicada

2 horas semanales , Integrante del equipo

Equipo: RODRÍGUEZ-COLLAZO,SILVIA , LANZILLOTTA, B.

Palabras clave: modelos de predicción modelización no lineal demanda de energía eléctrica

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series Temporales

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN Y DESARROLLO

Aceleración reciente del crecimiento económico en Uruguay: ¿cambio estructural o episódico? ¿viento de popa o buenas políticas? (12/2012 - 05/2014)

Durante la última década, Uruguay experimentó un crecimiento promedio anual cercano al 7%. A primera vista, esta expansión en el nivel de actividad es excepcional en la historia reciente de Uruguay. Esto plantea inmediatamente preguntas de gran relevancia: ¿estamos en presencia de un quiebre estructural en el proceso de crecimiento?; este quiebre ¿se caracteriza por un cambio permanente en la tendencia?; ¿están los movimientos cíclicos más amortiguados?; el crecimiento excepcional, ¿se explica por la profundización en la utilización de factores o por el progreso

técnico?; más allá de los determinantes inmediatos (factores de producción y progreso técnico) ¿qué incidencia tienen los factores fundamentales?, en particular, ¿qué parte cabe adjudicar a los factores externos y qué parte a los factores internos?, entre estos últimos, en particular, ¿qué papel han jugado los cambios en las políticas económicas, tanto en materia de reformas estructurales como en la gestión macroeconómica? Este estudio se plantea estudiar este proceso y dar respuesta a esas preguntas, abordando el problema con una perspectiva de mediano plazo, esto es, abarcando aproximadamente las últimas cuatro décadas. Para analizar los cambios estructurales y los quiebres se utilizará tanto la metodología de modelos estructurales con flitros de Kalman, y los contrastes de Bai y Perron (1998). Mediante modelos multiecuacionales se estudia la influencia de factores externos e internos en el crecimiento. Se analiza particularmente la contribución de las políticas económicas, tanto reformas estructurales como macroeconómicas, de modo de obtener resultados de interés para la formulación de políticas.

7 horas semanales

CINVE

Desarrollo

Integrante del Equipo

Concluido

Equipo: LANZILOTTA,B. , NOYA,N. (Responsable) , REGO,S., ZUNINO,G.

Palabras clave: productividad total de factores, crecimiento

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía del crecimiento

Modelos de predicción de demanda horaria de energía (11/2012 - 02/2014)

La imposibilidad de almacenar la energía eléctrica hace de la predicción una herramienta fundamental e indispensable a la hora de gestionar eficientemente su producción. La modelización de la demanda de energía eléctrica permite al ente productor contar con un conocimiento más refinado de los mercados y de los usuarios del sistema, así como una mejor posición a través de la reducción de la incertidumbre para la toma de decisiones. El objetivo de este trabajo consiste en la elaboración de un sistema de predicción para el corto plazo, basado en modelos horarios articulados con los modelos diarios de predicción. Con ese objeto se estiman y evalúan dos propuestas metodológicas para la predicción de la demanda horaria. Por un lado la propuesta base para la comparación (modelos benchmark) consiste en la estimación de un modelo univariante ARIMA-IA para una única serie horaria encadenada que incorpora los efectos de los días especiales, eventos atípicos y un componente SARIMA. Por otro lado se estiman 24 modelos, uno para cada hora del día. Estos modelos contemplan el efecto de los días especiales, las variables climáticas, los efectos lineales y no lineales en la demanda de la variable temperatura, eventos atípicos y un componente SARIMA que recoge la estructura periódica que conservan las series luego del filtrado de estos aspectos mencionados. Se analiza y evalúa la performance predictiva individual de los modelos y se compara el desempeño de ambas alternativas. Finalmente, se compara el desempeño predictivo a un día de estos modelos y se contrasta con los resultados del modelo diario

10 horas semanales

CINVE

Investigación

Integrante del Equipo

Concluido

Equipo: LANZILOTTA,B. (Responsable) , RODRÍGUEZ-COLLAZO,SILVIA

Palabras clave: Predicción energía eléctrica demanda horaria

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Predicción, Series Temporales

DOCENCIA

Programa de formación en métodos cuantitativos (05/2011 - 08/2019)

Especialización

Invitado

Asignaturas:

Análisis de Series Temporales y Técnicas de Predicción, 20 horas, Teórico-Práctico

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

CAPACITACIÓN/ENTRENAMIENTOS DICTADOS

CINVE (11/2014 - 11/2014)

Talleres para la estimación de modelos de demanda de energía eléctrica
4 horas semanales

Revisión de Modelos Predictivos de Series Temporales de ANTEL
5 horas semanales

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción de demanda

SERVICIO TÉCNICO ESPECIALIZADO

Monitoreo Macroeconómico REDSUR-FONPLATA (08/2019 - a la fecha)

4 horas semanales

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

SECTOR EXTRANJERO/INTERNACIONAL/OTROS - ALEMANIA

ICON-INSTITUTE GmbH & Co. KG Consulting Gruppe

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Funcionario/Empleado (06/2010 - 02/2011)

Consultor Senior 40 horas semanales

Consultora senior para Uruguay para diseñar la metodología de desestacionalización a aplicar a estadísticas armonizadas, monetarias y de crédito del MERCOSUR así como la estimación de las series desestacionalizadas para Uruguay (Estas tareas se realizan coordinadamente con un equipo de trabajo integrado por técnicos para los cuatro países del MERCOSUR).

ACTIVIDADES

PROYECTOS DE INVESTIGACIÓN Y DESARROLLO

Armonización de estadísticas monetarias de crédito y tasas de interés (06/2010 - 02/2011)

Consultora senior para Uruguay. Las actividades del proyecto consisten en el diseño del procedimiento recomendado para la desestacionalización de series monetarias y de crédito, armonizadas del MERCOSUR, la estimación de un conjunto de series desestacionalizadas para Uruguay y la capacitación y transferencia de conocimientos a funcionarios del Banco Central del Uruguay.

40 horas semanales

Investigación

Concluido

Financiación:

Institución del exterior, Remuneración

Equipo:

Palabras clave: Desestacionalización, X-12 ARIMA

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción macroeconómica

DOCENCIA

(06/2010 - 02/2011)

Perfeccionamiento

Responsable

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción macroeconómica

SERVICIO TÉCNICO ESPECIALIZADO

(06/2010 - 02/2011)

10 horas semanales

SECTOR GOBIERNO/PÚBLICO - PRESIDENCIA DE LA REPÚBLICA Y UNIDADES DEPENDIENTES - URUGUAY

Oficina de Planeamiento y Presupuesto

VÍNCULOS CON LA INSTITUCIÓN

Otro (03/1994 - 11/1995)

Economista del proyecto URUCIB 20 horas semanales

Economista de la Oficina de Planeamiento y Presupuesto del proyecto "Informática para la Presidencia de la República" del área económica del proyecto URUCIB.

ACTIVIDADES

LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

Indicadores de avance de la actividad económica (03/1994 - 09/1995)

La tarea consistía en el mantenimiento y difusión de una base de datos sociales y económicos, elaboración de informes de coyuntura y desarrollo de indicadores de avance de la actividad económica.

20 horas semanales

OPP, Informática-Proyecto URUCIB, Integrante del equipo

Equipo: ORDEIX,M. , GARCÍA, B.

Palabras clave: coyuntura económica

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría-Coyuntura económica

CARGA HORARIA

Carga horaria de docencia: 10 horas

Carga horaria de investigación: 27 horas

Carga horaria de formación RRHH: 2 horas

Carga horaria de extensión: Sin horas

Carga horaria de gestión: 1 hora

Producción científica/tecnológica

Producción bibliográfica

ARTÍCULOS PUBLICADOS

ARBITRADOS

Testing linearity in the long-run relationship between economic growth and passenger air transport in Mexico (Completo, 2016)

BRIDA GABRIEL , LANZILOTTA BIBIANA , RODRÍGUEZ-BRINDIS,M. , RODRÍGUEZ,S.

International Journal of Transport Economics, v.: 4 VOL. XLIII , 2016

Palabras clave: air transport and growthnon linear cointegration

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía del Turismo

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Roma

ISSN: 03918440

E-ISSN: 0391-8440

<http://www.ijte.org/>

Scopus® WEB OF SCIENCE™

Modelos de predicción de energía eléctrica con datos horarios para Uruguay (Completo, 2016) Trabajo relevante

LANZILOTTA,B. , RODRÍGUEZ,S.

Cuadernos de CIMBAGE, v.: 18 p.:1 - 28, 2016

Palabras clave: Modelos de predicción demanda de energía eléctrica Datos de alta frecuencia Uruguay

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura y Predicción

Medio de divulgación: Internet

Lugar de publicación: Argentina

Escrito por invitación

ISSN: 16691830

<http://bibliotecadigital.econ.uba.ar/library.cgi?c=cuadcimbage&a=d&cl=CL1>

NO ARBITRADOS

Las expectativas empresariales: ¿aportan información valiosa para anticipar la producción industrial en Uruguay?. (Completo, 2015)

LANZILOTTA,B. , RODRÍGUEZ,S. , DOMÍNGUEZ,M. , FORNASARI,N. , PARESCHI,F.

Espacio Industrial, 2015

Palabras clave: Expectativas empresariales Producción industrial

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de demanda de energéticos

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Uruguay

Escrito por invitación

ISSN: 15103595

Caracterización del número de personas privadas de libertad (Completo, 2007)

RODRÍGUEZ,S. , NALBARTE, L.

Quantum, v.: II 1 , p.:29 - 42, 2007

Palabras clave: modelos ARIMA,componentes no observables

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Uruguay

ISSN: 07977859

<http://www.quantum.edu.uy/numero1.htm>

La tasa de desempleo de Montevideo: ¿raíz unitaria o cambio estructural? (Completo, 2001)

BADAGIÁN, A.L. , GOYENECHE, J.J. , RODRÍGUEZ,S. , SELVES,R.

Serie Documentos de Trabajo (IESTA), v.: 01 01 , p.:1 - 23, 2001

Palabras clave: tasa de desempleo,persistencia,quiebre

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Medio de divulgación: Internet

Lugar de publicación: Uruguay

E-ISSN: 16886453

<http://www.iesta.edu.uy/publicaciones/>

Paridad de poder de compra en el MERCOSUR: un análisis a partir de la evolución a largo plazo del tipo de cambio real (Completo, 2000)

CANCELO, J.R. , FERNÁNDEZ, A. , RODRÍGUEZ,S. , URRESTARAZU, I. , GOYENECHE, J.J

Quantum, v.: 5 11 , p.:57 - 73, 2000

Palabras clave: PPP, test raíz unitaria

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Medio de divulgación: Papel

Lugar de publicación: Uruguay

ISSN: 07977859

LIBROS

Theory and Applications of Time Series Analysis and Forecasting. ITISE 2021. Contributions to Statistics. (Participación , 2023) Trabajo relevante

LANZILOTTA, B. , RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Publicado, Contributions to Statistics

Editorial: Springer Nature, Switzerland AG

Tipo de publicación: Investigación

DOI: https://doi.org/10.1007/978-3-031-14197-3_15

Referado

Escrito por invitación

Palabras clave: Non-linear time series models Daily time series Electricity Climatic variables

Medio de divulgación: Papel

ISSN/ISBN: 978-3-031-14196-6

https://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-031-14197-3_15

This paper proposes a model for the daily electricity demand in Uruguay, identifying the incidence of special days (calendar effects, holidays, among others) and climatic variables such as temperature, humidity, winds, and heliophany. We propose a non-linear model to represent the association between energy consumption and climate variables. Applying Markov switching models and considering hot and cold months separately, identify breaks in the energy demand function associated with temperature thresholds. Predictive analysis during 2020, the first year of the health emergency, shows that the COVID-19 sanitary crisis did not deteriorate the model performance.

Capítulos:

Forecasting High-Frequency Electricity Demand in Uruguay

Organizadores: Valenzuela, O., Rojas, F., Herrera, L.J., Pomares, H., Rojas, I. (eds)

Página inicial 227, Página final 242

La investigación en estadística desde la mirada de cuatro jóvenes investigadores (Compilación , 2015)

RODRÍGUEZ, S., ÁLVAREZ, R., COIMBRA, A., MASSA, F., MORENO, L., VERNAZZA, E.

Publicado

Número de volúmenes: 1

Número de páginas: 198

Editorial: Comisión Sectorial de Investigación Científica

Tipo de publicación: Investigación

Referado

Palabras clave: estadística aplicada, jóvenes investigadores

Áreas de conocimiento:

Ciencias Naturales y Exactas / Matemáticas / Estadística y Probabilidad / Estadística aplicada

Medio de divulgación: Internet

ISSN/ISBN:

Financiación/Cooperación:

Comisión Sectorial de Investigación Científica / Otra, Uruguay

Violencia, inseguridad y miedos en el Uruguay ¿Qué tienen para decir las ciencias sociales? (Participación , 2008)

RODRÍGUEZ, S., NALBARTE LAURA

Publicado

Número de volúmenes: 1

Editorial: FESUR-REpresentación en Uruguay, Montevideo

Tipo de publicación: Investigación

Palabras clave: Predicción, ARIMA, componentes no observables

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Medio de divulgación: Internet

ISSN/ISBN:

<http://library.fes.de/pdf-files/bueros/uruguay/05815.pdf>

Capítulos:

Caracterización de la evolución del número de personas privadas de libertad

Organizadores:

Página inicial 55, Página final 68

DOCUMENTOS DE TRABAJO

Extensiones al modelo de segregación de Schelling, (2020)

Completo

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA , De Armas , Álvarez-Vaz , Carrasco , Ciganda

Medio de divulgación: Internet

https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/wp-content/uploads/2020/09/ddt_02_20.pdf

Determinantes del spread soberano en Uruguay (2020)

Completo

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA , Lorenzo , Mosteiro , Paganini

Palabras clave: Spreadsoberano ARCH heteroscedasticidad condicional

Medio de divulgación: Internet

https://cinve.org.uy/wp-content/uploads/2020/11/DT-01-2020-Lorenzo_Mosteiro_Paganini_Rodriguez.pdf

El crecimiento reciente de Uruguay y desacople de la región: ¿adiós a la semisuma? (2020)

Completo

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA , LANZILOTTA, B. , Mordecki , Presa

Serie: DT,

Palabras clave: desacople dependencia regional cointegración Uruguay

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iecon.ccee.edu.uy/dt-01-20-el-crecimiento-reciente-de-uruguay-y-desacople-de-la-region-ad>

Testing and Estimating Nonlinear Long-Run Relationships between Economic Growth and Passenger Air Transport in Four South American Countries (2018)

Completo

RODRÍGUEZ, S. , Brida, J.G. , Lanzilotta, B. , Zapata-Aguirre, S.

https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=3135459

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría /

Medio de divulgación: Internet

https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=3135459

INCERTIDUMBRE SOBRE EL PASADO Y SU INFLUENCIA SOBRE LA INCERTIDUMBRE FUTURA (2016)

Completo

RODRÍGUEZ, S.

Serie: DT,

Uruguay

Palabras clave: revisión en los datos data vintages error de predicción PIB Uruguay

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Predicción Macroeconómica

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/publicaciones/documentos-de-trabajo/documentos-de-trabajo-2016/>
El objetivo de este documento es avanzar en la caracterización de las revisiones en el Índice de Volumen Físico del Producto Bruto Interno agregado, esto implica explicitar las características de las revisiones para un período acotado y explorar el efecto de las mismas en las predicciones puntuales de las tasas de crecimiento anual y en el componente Tendencia-ciclo estimado. Se crea una base de datos que contiene un conjunto de 8 vintages consecutivos que cubren el período 2014 - 2015 y se realiza una breve caracterización de las revisiones en el dominio del tiempo y de las frecuencias.

Long-run relationship between economic growth and passenger air transport in Mexico (2014)

Completo

BRIDA GABRIEL , LANZILOTTA BIBIANA , BRINDIS, M , RODRÍGUEZ,S.

Serie: DT(14/04),

Uruguay

Palabras clave: nonlinear cointegration; nonparametric causality

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo no lineales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/publicaciones/documentos-de-trabajo/documentos-de-trabajo-2014/>

Abstract Air transport is a strategic factor that can play a key role in facilitating economic development, particularly in developing countries and in enhancing long-term economic growth. Conversely, the economic growth of a country can also have significant effects on air transport expansion. This paper analyzes the dynamic relationship between Mexican air transport (from the perspective of passengers movement) and economic growth. By applying nonlinear techniques, we explore whether air transport leads -on the long run- to economic growth, or, alternatively, economic expansion drives air transport growth, or indeed a bi-directional relationship exists between the two variables. To this end, non-parametric cointegration and non-parametric causality test are applied to quarterly data of GDP and air passengers in Mexico for the period 1995-2013. Our results show that we cannot reject the existence of a linearity relationship between air transport and economic growth. The nonparametric causality tests, confirm bidirectional causality between transport and growth. Finally, the paper compares the results of the nonlinear approach with those obtained by using the traditional linear methodology.

MODELOS DE PREDICCIÓN DE ENERGÍA ELÉCTRICA CON DATOS HORARIOS PARA URUGUAY (2014) Trabajo relevante

Completo

LANZILOTTA BIBIANA , RODRÍGUEZ,S.

Serie: DT,

CINVE

Palabras clave: series alta frecuencia, estacionalidad múltiple

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta frecuencia

Medio de divulgación: Internet

<http://www.cinve.org.uy/workingpapers/dt-012014-modelos-de-prediccion-de-energia-electrica-con-datos>

Resumen La imposibilidad de almacenar la energía eléctrica hace de la predicción una herramienta fundamental e indispensable a la hora de gestionar eficientemente su producción. La modelización de la demanda de energía eléctrica permite al ente productor contar con un conocimiento más refinado de los mercados y de los usuarios del sistema, así como una mejor posición a través de la reducción de la incertidumbre para la toma de decisiones. El objetivo de este trabajo consiste en la elaboración de un sistema de predicción para el corto plazo, basado en modelos horarios articulados con los modelos diarios de predicción. Con ese objeto se estiman y evalúan dos propuestas metodológicas para la predicción de la demanda horaria. Por un lado la propuesta base para la comparación (modelos benchmark) consiste en la estimación de un modelo univariante ARIMA-IA para una única serie horaria encadenada que incorpora los efectos de los días especiales, eventos atípicos y un componente SARIMA. Por otro lado se estiman 24 modelos, uno para cada hora del día. Estos modelos contemplan el efecto de los días especiales, las variables climáticas, los efectos lineales y no lineales en la demanda de la variable temperatura, eventos atípicos y un componente SARIMA que recoge la estructura periódica que conservan las series luego del filtrado de estos aspectos mencionados. Se analiza y evalúa la performance predictiva individual de los modelos y se compara el desempeño de ambas alternativas. Finalmente, se compara el desempeño predictivo a un día de estos modelos y se contrasta con los resultados del modelo diario.

Econometría e investigación en Economía en Uruguay. Una visión a través de los trabajos presentados en las Jornadas Anuales de Economía del Banco Central de Uruguay (2013)

Completo

GHAZARIAN, M , FERNÁNDEZ,A , RODRÍGUEZ,S.

Serie: DT,

CINVE

Palabras clave: Investigación-Econometría-uruguay

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Investigación en Econometría

Medio de divulgación: Internet

http://www.cinve.org.uy/wp-content/uploads/2015/06/Ghazarian_Fernandez_Rodriguez.pdf

REsumen El presente artículo resume los principales rasgos de los trabajos presentados a las Jornadas Anuales de Economía del Banco Central del Uruguay en los últimos 20 años, enfatizando en la metodología econométrica aplicada en los mismos. Se clasifican los 871 trabajos presentados entre 1993 y 2012, considerando el tema del artículo y la técnica econométrica utilizada. La clasificación temática se realiza según las categorías establecidas por el JEL (Journal of Economic Literature), mientras que para el uso de técnicas econométricas se construye una clasificación propia. Se confirma que cuatro capítulos de la clasificación JEL (Métodos matemáticos y cuantitativos, Macroeconomía y economía monetaria, Economía internacional y Economía financiera) concentran más de la mitad del total. En la comparación internacional de las temáticas abordadas, los trabajos presentados a las JAE tienen una mayor participación de las cuatro disciplinas antes mencionadas. Si se considera específicamente los trabajos que incluyen técnicas econométricas, este número pasa de 34% entre 1993-1997, a cerca de 80% en los últimos cinco años, 2008-2012.

¿ESTACIONALIDAD DETERMINÍSTICA O ESTOCÁSTICA EN LOS COMPONENTES DEL PRODUCTO? (2012)

Completo

RODRÍGUEZ,S.

Serie: DT(12/01),

www.iesta.edu.uy

Palabras clave: Integración estacional, HEGY, Canova-Hansen

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

www.iesta.edu.uy

Desde hace unos años se ha prestado especial atención a la caracterización de las propiedades estacionales de las series macroeconómicas, se discute si la mejor representación para la estacionalidad es a través de variables indicatrices o considerarla cambiante a través del tiempo, o incluso si la estacionalidad está gobernada por tendencias estocásticas en las frecuencias estacionales, esto es concibiendo que el polinomio autorregresivo estacional contiene alguna raíz unitaria en las frecuencias estacionales. La forma más simple de filtrar la estacionalidad es mediante la incorporación de variables indicatrices, las que se suman al modelo de modo de aislar el componente estacional. Esta modalidad implica sostener que la estacionalidad de la serie es de carácter determinístico. Otra forma usual de filtrar la estacionalidad es mediante la diferencia estacional. Este filtro supone la presencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales y en la frecuencia cero, se aplica con el objeto de convertir a la serie filtrada en estacionaria. En este marco, surgen diferentes tests para contrastar la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales, entre ellos se encuentran los propuestos por Canova y Hansen (1995) y Hylleberg, Engle, Granger y Yoo, HEGY (1990). Estos tests se instrumentan a partir de hipótesis nulas completamente diferentes, en el test propuesto por Canova-Hansen, la hipótesis nula es que la estacionalidad del proceso es de tipo determinística, mientras que en el test de Hylleberg, Engle, Granger y Yoo la hipótesis nula es que el proceso contiene raíces unitarias en las frecuencias estacionales. El objetivo del trabajo es caracterizar la estacionalidad de la serie de índice de volumen físico del producto bruto interno de Uruguay (IVF PBIU) y sus componentes. Se considera la serie desagregada por industrias. Mediante la aplicación de dos tipos de test, HEGY y Canova-Hansen se pretende obtener una primer caracterización de las propiedades estacionales de estas series. El análisis empírico se realiza sobre la serie armonizada de índice de volumen físico del producto bruto interno (IVF PBI) de Uruguay con base en el año 2005 y el producto desagregado por industrias elaboradas 1997-2011 publicadas por el Banco Central del Uruguay (BCU) todas ellas de frecuencia trimestral. En términos generales los resultados de los tests muestran diferencias, excepto en la serie de producto industrial, donde ambos test rechazan la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales. En el caso del IVF PBIU agregado ambos tests difieren en los resultados para todas las frecuencias. Estos tests son de carácter complementario, si ambos test llegan al mismo resultado, se puede tener mayor confianza en los resultados, si difieren se requiere de un análisis más profundo y considerar más información para definir la caracterización.

Caracterización de la estacionalidad de los componentes del PBI uruguayo (2012)

Completo

RODRÍGUEZ,S.

Serie: DT(12/02),

www.iesta.edu.uy

Palabras clave: Estacionalidad evolutiva, PBI, Canova-Hansen, HEGY

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

www.iesta.edu.uy

El presente documento describe la metodología y los resultados para la caracterización de la estacionalidad en las series económicas trimestrales de los componentes del gasto del PBI comprendidas entre los años 1988 y 2011. Las metodologías empleadas son las de Hylleberg et al. y Canova-Hansen. Ambos tests son complementarios en el sentido en que el la hipótesis nula del primero de ellos postula la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales, mientras que el segundo parte del supuesto de que los ciclos estacionales son determinísticos. Adicionalmente, dado un cambio en la metodología de construcción de las series, se considera el tratamiento de un quiebre en la estacionalidad. Los resultados indican que, pese a que en primera instancia se pudo pensar en la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales en algunas series, esta conclusión se desvanece al incluir variables de regresión que capten el efecto del cambio de metodológico.

Persistencia inflacionaria y Pass Through salarial en Uruguay (2012)

Completo

LANZILLOTTA, B., DOMÍNGUEZ, MAGDALENA, REGO, S., REGUEIRA, P., RODRÍGUEZ, S.

Serie: 2012, v: 11

Uruguay

Palabras clave: Inflación, Pass through, Persistencia

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Métodos Cuantitativos, Política Monetaria

Medio de divulgación: Internet

www.cinve.org.uy

La formación de precios y la persistencia inflacionaria son elementos claves para el correcto diagnóstico de las presiones y las decisiones derivadas de política monetaria en pos de la estabilidad de precios. En economías como la uruguaya es clave entender el rol del traslado de salarios a precios para poder comprender y analizar tanto los cambios como la dinámica de la inercia inflacionaria. Este artículo estudia la causalidad entre persistencia inflacionaria y la dinámica del traslado a precios de los salarios en Uruguay desde fines de los 90 hasta la actualidad, a partir de estimaciones rolling de ambas variables. Los resultados permiten afirmar que el nivel de pass through salarial juega un rol importante en el nivel de persistencia inflacionaria, pudiéndose identificar causalidad en el sentido de Granger desde el pass through salarial hacia la persistencia inflacionaria.

Revisión en las series desestacionalizadas por X-12 ARIMA y SEATS. Aplicación a los Medios de pago, serie armonizada para el MERCOSUR (2011)

Completo

RODRÍGUEZ, S.

Serie: DT,

www.iesta.edu.uy

Palabras clave: , Revisión, Medios de pago, X-12 ARIMA, SEATS

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

www.iesta.edu.uy

Recientemente se ha realizado un importante esfuerzo en la creación de nuevas estadísticas monetarias y de crédito armonizadas para el MERCOSUR. La creación y su consiguiente actualización de estas bases de datos son un nuevo instrumento para el análisis de los principales agregados monetarios de los países del bloque. Este trabajo se centra en el estudio de uno de los agregados monetarios, los medios de pago (M1) armonizados, de Uruguay. Tanto el Banco Central del Uruguay como analistas económicos observan la evolución de la cantidad de dinero con atención. Las estimaciones de los componentes inobservables de este indicador pueden brindar información relevante en el seguimiento de la trayectoria de la serie. En este caso particular la elección de la serie armonizada tiene por objeto incursionar en el estudio de la trayectoria de esta nueva serie. Este trabajo primariamente estima la evolución del componente estacional y de la serie desestacionalizada considerando dos métodos alternativos para obtener los componentes, por un lado un método empiricista, ampliamente utilizado, el X-12 ARIMA y por otro un método basado en modelos ARIMA, SEATS. El proceso de estimación de los componentes inobservables viene ineludiblemente asociado a la revisión de las estimaciones. En este trabajo se cuantifica y analiza la

magnitud y duración de las revisiones en los componentes inobservables estimados, resultado de aplicar las dos metodologías. Se cuantifican las revisiones en los datos estimados cuando se sustituye el dato predicho de la serie original o agregada, por el dato efectivamente observado

Modelos estocásticos para predecir la demanda de gas licuado de petróleo en Uruguay (2010)

Completo

RODRÍGUEZ, S.

Serie: DT,

www.iesta.edu.uy

Palabras clave: Demanda de GLP, ARIMA, MCE

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

www.iesta.edu.uy

En Uruguay el gas licuado de petróleo (GLP) se destina principalmente al uso domiciliario en calefacción y cocción. Este trabajo surge como una extensión a un trabajo originado a partir de un convenio con ANCAP en que se elaboraron un conjunto de modelos de demanda de combustibles líquidos y GLP. Este documento tiene dos objetivos, primero obtener pronósticos de demanda de GLP diaria y mensual mediante modelos de series temporales y segundo, analizar la variación del desempeño predictivo de estos modelos de demanda, al incorporar la variable temperatura como variable exógena. Se plantean diferentes aproximaciones metodológicas para obtener las proyecciones de demanda de GLP. Se estiman modelos univariados (SARIMA-IA) y multivariados (VEC). A partir de los primeros, se obtienen pronósticos de demanda con frecuencia diaria y mensual, mientras que con los modelos multivariados se obtienen pronósticos de demanda mensuales. Se evalúa la performance predictiva de los distintos modelos en diferentes horizontes de proyección y su sensibilidad ante la incorporación de información adicional. Se estudia el papel que juega la variable temperatura, considerando diversas alternativas, en el desempeño predictivo del modelo. El modelo de predicción diario, por su flexibilidad y buen desempeño predictivo es una herramienta adecuada para planificar la demanda de corto plazo. Al incorporar la temperatura, el error de predicción del modelo disminuye, pero en menor medida que en el modelo mensual. La inclusión de la variable temperatura en el modelo de demanda mensual mejora el desempeño predictivo en el período más sensible de la planificación, los primeros meses de frío. En el modelo multivariado la mejora en el desempeño predictivo se asocia con toda la información adicional incorporada y no únicamente por la variable temperatura, aunque sin ella el modelo empeora su desempeño predictivo. Los modelos presentados son complementarios en lo que a horizontes de predicción se refiere, son útiles para la tarea de planificar la demanda de GLP brindando recursos para proyectar la misma apoyada en modelos estocásticos, con diferentes requerimientos de información.

Producto potencial y brecha de producto en Uruguay (2008)

Completo

RODRÍGUEZ, S., ALVAREZ, I., DA SILVA, N.

Serie: I, v: 801

Página web del IESTA

Palabras clave: filtros, brecha de producto

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/wp-content/uploads/2010/03/0801.pdf>

El producto potencial puede denirse como el nivel de producto que la economía es capaz de alcanzar con los factores productivos disponibles y la tecnología existente sin generar presiones inflacionarias. La brecha de producto es la diferencia (o proporción) entre el producto potencial y el efectivo. El objetivo de este trabajo es estimar la brecha de producto mediante filtros lineales. En particular se estima la brecha de producto para la economía uruguaya en el año 2008, utilizando la serie de datos de Índice de volumen físico trimestral desde el primer trimestre del año 1975 al cuarto trimestre del año 2007. Se utilizan los filtros de Holdrick Prescott y Christiano Fitzgerald sobre datos prefiltrados utilizando la metodología de descomposición basada en modelos ARIMA. La brecha de producto es una herramienta utilizada comúnmente como indicador de presiones inflacionarias, sin embargo es relevante complementar su estudio con el nivel del producto potencial para tener un panorama completo de la evolución de la economía. Por esta razón también se presentan las estimaciones del producto potencial.

Dinámicas no lineales y ciclos asimétricos en Argentina, Brasil y Uruguay (2004) Trabajo relevante

Completo

RODRÍGUEZ, S., BADAGIÁN, A.L.

Serie: I,

Página web del IESTA

Palabras clave: ciclos asimétricos, test Triples, filtros lineales

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series temporales, extracción de señales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/wp-content/uploads/2010/03/0402.pdf>

La presencia de asimetrías cíclicas en series económicas tiene importantes implicaciones tanto desde el punto de vista de la teoría económica como desde la perspectiva de la modelización y predicción. La idea de que algunas variables económicas presentan dinámicas asimétricas en el tiempo y que la economía opera en forma diferente en las distintas fases del ciclo de negocios no es nueva; en 1984 Neftci encuentra dinámicas asimétricas en el desempleo de Estados Unidos, pero recién en los noventa se retoma con fuerza esta preocupación en la literatura económica. Dado que en Uruguay no se han publicado gran cantidad de trabajos al respecto, este artículo pretende contribuir a la discusión de estos temas. El documento abarca dos aspectos; primeramente, estudia si existen asimetrías en los componentes cíclicos de los productos de Argentina, Brasil y Uruguay, y en segundo lugar, analiza si los resultados del test Triples son sensibles a la aplicación de diversas metodologías de descomposición para obtener el ciclo. Mediante la aplicación del test no paramétrico Triples, propuesto por Randles, Flinger, Policello y Wolfe en 1980, se contrasta la hipótesis de asimetría. El estudio de las dinámicas asimétricas se centra aquí en dos tipos específicos de asimetrías: transversal y/o longitudinal. Hay asimetría transversal si, durante las fases recesivas, los valles del ciclo son más profundos que el alto de los picos, cuando se transita por una expansión. Se verifica asimetría longitudinal cuando, en las recesiones, la caída en el producto es rápida y las recuperaciones son lentas. Este test se realiza sobre uno de los componentes no observables del producto, el ciclo. Dado que existen diversas metodologías para extraer este componente, en este trabajo se estudia la sensibilidad de los resultados del test Triples a los métodos de descomposición aplicados. Así, el ciclo se estima mediante el método estructural propuesto por Harvey (1981), el método basado en modelos ARIMA propuesto por Maravall (1987) combinado con el filtro de Hodrick Prescott (1982) y el método propuesto por Baxter King (1995). Los resultados de los contrastes indican que existe evidencia para afirmar que hay asimetría de tipo deepness en los ciclos de los productos de Argentina y Uruguay, sin embargo la asimetría de tipo steepness sólo se verifica en el ciclo Argentino. El método de descomposición aplicado afecta los resultados del test de asimetría Triples.

La tasa de desempleo de Montevideo ¿raíz unitaria o cambio estructural? (2001)

Completo

RODRÍGUEZ, S., SELVES, R., BADAGIÁN, A.L., GOYENECHE, J.J

Serie: I,

Página web del IESTA

Palabras clave: desempleo, persistencia, quiebres endógenos

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/wp-content/uploads/2010/03/0101.pdf>

Paridad de poder de compra en el MERCOSUR: un análisis a partir de la evolución a largo y mediano plazo del tipo de cambio real. (2000)

Completo

CANCELO, J.R., FERNÁNDEZ, A., RODRÍGUEZ, S., URRESTARAZU, I., GOYENECHE, J.J

Serie: I,

Página web del IESTA

Palabras clave: PPP, raíz unitaria, tendencia segmentada

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/wp-content/uploads/2010/03/0001.pdf>

Aplicación de contrastes de raíces unitarias estacionales a series mensuales de precios de bienes transables y no transables (1998)

Completo

RODRÍGUEZ, S., DAUDE, C., SAPRIZA, H.

Montevideo

Palabras clave: raíces unitarias estacionales

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Medio de divulgación: Papel

El comportamiento de largo plazo de los tipos de cambio real en el MERCOSUR (1998)

Completo

CANCELO, J.R., RODRÍGUEZ, S., FERNÁNDEZ, A.

Serie: I,

Página web del IESTA

Palabras clave: PPP, raíz unitaria, tendencia segmentada

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.iesta.edu.uy/wp-content/uploads/2010/03/9801.pdf>

PUBLICACIÓN DE TRABAJOS PRESENTADOS EN EVENTOS

INCERTIDUMBRE SOBRE EL PASADO Y SU INFLUENCIA SOBRE LA INCERTIDUMBRE FUTURA (2016)

RODRÍGUEZ, S.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Académicas 2016. Facultad de Ciencias Económicas y Administración

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2016

Palabras clave: revisión en los datos data vintages error de predicción

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Predicción Macroeconómica

Medio de divulgación: Internet

http://www.fcea.edu.uy/Jornadas_Academicas/2016/

Predicción y estacionalidad intradiaria de la demanda de energía eléctrica en Uruguay (2014)

RODRÍGUEZ, S., MASSA, F.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Académicas. Facultad de Ciencias Económicas y Administración

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2014

Palabras clave: series alta frecuencia, estacionalidad múltiple

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta frecuencia

Medio de divulgación: Internet

<http://www.ccee.edu.uy/jacad/2014/index.html#ponencias>

Resumen Las series horarias con fuerte patrón estacional se caracterizadas por la alta frecuencia con la que se registran los datos. En la medida que el registro es muy frecuente es posible captar periodicidades en los datos que no son detectables cuando la información aparece agregada. La modelización de la demanda horaria de energía eléctrica debería contemplar la existencia de múltiples estacionalidades, el efecto de los días especiales, fines de semana, feriados, e incluso la influencia de variables de tipo meteorológico. En este trabajo se estima y predice la demanda por hora y a lo largo del día de energía eléctrica de Uruguay, mediante 24 modelos horarios, uno para cada hora del día. A partir de la aplicación del test HEGY adaptado a series de frecuencia diaria, Rubia (2001), se define una representación determinística para captar las periodicidades intra semanales dentro del modelo. El proceso de modelización se realiza en dos etapas, en la primer etapa el modelo recoge la periodicidad semanal, incorporando su interacción con los días especiales. En la segunda etapa se incorpora la estacionalidad mensual mediante la inclusión de variables meteorológicas considerando el vínculo no lineal entre la demanda de energía eléctrica y la temperatura, así como los eventos atípicos y un componente SARIMA-IA para recoger la estructura remanente. El vínculo no lineal entre demanda de energía eléctrica y temperatura se especifica

mediante la inclusión de umbrales. La búsqueda iterativa de los umbrales se realiza siguiendo la propuesta de Cancelo y Espasa (1991) y Cancelo et al. (2008).

Long-run relationship between economic growth and passenger air transport in Mexico (2014)

BRIDA GABRIEL , LANZILOTTA BIBIANA , BRINDIS, M , RODRÍGUEZ,S.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Académicas. Facultad de Ciencias Económicas y Administración

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2014

Palabras clave: nonlinear cointegration; nonparametric causality

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo no lineales

Medio de divulgación: Internet

<http://www.ccee.edu.uy/jacad/2014/index.html#ponencias>

Abstract Air transport is a strategic factor that can play a key role in facilitating economic development, particularly in developing countries and in enhancing long-term economic growth. Conversely, the economic growth of a country can also have significant effects on air transport expansion. This paper analyzes the dynamic relationship between Mexican air transport (from the perspective of passengers movement) and economic growth. By applying nonlinear techniques, we explore whether air transport leads -on the long run- to economic growth, or, alternatively, economic expansion drives air transport growth, or indeed a bi-directional relationship exists between the two variables. To this end, non-parametric cointegration and non-parametric causality test are applied to quarterly data of GDP and air passengers in Mexico for the period 1995-2013. Our results show that we cannot reject the existence of a linearity relationship between air transport and economic growth. The nonparametric causality tests, confirm bidirectional causality between transport and growth. Finally, the paper compares the results of the nonlinear approach with those obtained by using the traditional linear methodology.

MODELOS DE PREDICCIÓN DIARIA Y HORARIA DE LA DEMANDA DE ENERGÍA ELÉCTRICA EN URUGUAY (2014)

Trabajo relevante

LANZILOTTA BIBIANA , RODRÍGUEZ,S.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Anuales de Economía del Banco Central del Uruguay

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2014

Palabras clave: series alta frecuencia, estacionalidad múltiple

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta frecuencia

Medio de divulgación: Internet

http://www.bcu.gub.uy/Comunicaciones/Paginas/Jornadas_de_Economia_Trab_Presentados_2014.aspx

Resumen La imposibilidad de almacenar la energía eléctrica hace de la predicción una herramienta fundamental e indispensable a la hora de gestionar eficientemente su producción. La modelización de la demanda de energía eléctrica permite al ente productor contar con un conocimiento más refinado de los mercados y de los usuarios del sistema, así como una mejor posición a través de la reducción de la incertidumbre para la toma de decisiones. El objetivo de este trabajo consiste en la elaboración de un sistema de predicción para el corto plazo, basado en modelos horarios articulados con los modelos diarios de predicción. Con ese objeto se estiman y evalúan dos propuestas metodológicas para la predicción de la demanda horaria. Por un lado la propuesta base para la comparación (modelos benchmark) consiste en la estimación de un modelo univariante ARIMA-IA para una única serie horaria encadenada que incorpora los efectos de los días especiales, eventos atípicos y un componente SARIMA. Por otro lado se estiman 24 modelos, uno para cada hora del día. Estos modelos contemplan el efecto de los días especiales, las variables climáticas, los efectos lineales y no lineales en la demanda de la variable temperatura, eventos atípicos y un componente SARIMA que recoge la estructura periódica que conservan las series luego del filtrado de estos aspectos mencionados. Se analiza y evalúa la performance predictiva individual de los modelos y se compara el desempeño de ambas alternativas. Finalmente, se compara el desempeño predictivo a un día de estos modelos y se contrasta con los resultados del modelo diario.

en las Jornadas Anuales de Economía del Banco Central de Uruguay (2013)

MARIANA GHAZARIAN , ADRIÁN FERNÁNDEZ PONCET , RODRÍGUEZ,S.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Anuales de Economía del Banco Central del Uruguay

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2013

Palabras clave: Investigación - econometría-Uruguay

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Métodos cuantitativos

Medio de divulgación: Internet

http://www.cinve.org.uy/wp-content/uploads/2015/06/Ghazarian_Fernandez_Rodriguez.pdf

Resumen El presente artículo resume los principales rasgos de los trabajos presentados a las Jornadas Anuales de Economía del Banco Central del Uruguay en los últimos 20 años, enfatizando en la metodología econométrica aplicada en los mismos. Se clasifican los 871 trabajos presentados entre 1993 y 2012, considerando el tema del artículo y la técnica econométrica utilizada. La clasificación temática se realiza según las categorías establecidas por el JEL (Journal of Economic Literature), mientras que para el uso de técnicas econométricas se construye una clasificación propia. Se confirma que cuatro capítulos de la clasificación JEL (Métodos matemáticos y cuantitativos, Macroeconomía y economía monetaria, Economía internacional y Economía financiera) concentran más de la mitad del total. En la comparación internacional de las temáticas abordadas, los trabajos presentados a las JAE tienen una mayor participación de las cuatro disciplinas antes mencionadas. Si se considera específicamente los trabajos que incluyen técnicas econométricas, este número pasa de 34% entre 1993-1997, a cerca de 80% en los últimos cinco años, 2008-2012.

Persistencia inflacionaria y Pass Through salarial :diagnóstico y causalidad (2012)

LANZILOTTA,B. , RODRÍGUEZ,S. , DOMÍNGUEZ, MAGDALENA , REGO,S.

Publicado

Completo

Evento: Nacional

Descripción: Jornadas Anuales de Economía

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2012

Palabras clave: Inflación

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Métodos Cuantitativos, Política Monetaria

Medio de divulgación: Internet

www.bcu.gub.uy

Estimación del producto potencial y brecha de producto en Uruguay mediante filtros lineales (2008)

RODRÍGUEZ,S.

Publicado

Completo

Evento: Regional

Descripción: Congreso Latinoamericano de Estadística-CLATSE

Ciudad: Montevideo

Año del evento: 2008

Palabras clave: brecha de producto, filtros lineales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción macroeconómica

Medio de divulgación: CD-Rom

www.iesta.edu.uy/publicaciones

TEXTOS EN PERIÓDICOS O REVISTAS

Impactos del Covid-19 sobre el producto potencial de Uruguay (2021)

SUMA

Revista

RODRÍGUEZ-COLLAZO,SILVIA

Palabras clave: COVID-19 Producto potencial
Medio de divulgación: Internet
Fecha de publicación: 01/06/2021
<http://suma.org.uy/?p=766>

Déficit fiscal, ley de urgencia y ajuste fiscal (2020)

SUMA
Revista
RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Palabras clave: déficit fiscal ajuste fiscal
Medio de divulgación: Internet
Fecha de publicación: 18/03/2020
<http://suma.org.uy/?p=563>

¿Cuántos vendrán? Un verano inquietante. (2019)

SUMA
Revista
RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Medio de divulgación: Internet
Fecha de publicación: 08/10/2019
<http://suma.org.uy/?p=521>

Incertidumbre y efecto manada? en la predicción del PIB (2018)

SUMA
Revista
RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Palabras clave: incertidumbre predicción PIB
Medio de divulgación: Internet
<http://suma.org.uy/?p=381>

Producción técnica

TRABAJOS TÉCNICOS

Proyección a mediano y largo plazo de la demanda de energéticos. Informe Final (2010)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ, S.
Informe Final
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restringida

Número de páginas: 50
Duración: 6 meses
Institución financiadora: ANCAP
Palabras clave: demanda energéticos, mediano plazo
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de demanda de energéticos
Medio de divulgación: Papel

Modelos de Predicción de la demanda de combustibles líquidos y supergas (2009)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ, S.
Informe Final
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restringida

Número de páginas: 50
Duración: 9 meses
Institución financiadora: ANCAP
Palabras clave: Predicción de demanda
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de predicción de demanda
Medio de divulgación: Papel

Modelización univariada y descomposición de indicadores adelantados de actividad económica (2008)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ, S.
Asesoría
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restringida

Número de páginas: 68
Duración: 2 meses
Institución financiadora: Instituto de Estadística INE
Palabras clave: componentes no observables, predicción
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Predicción macroeconómica
Medio de divulgación: Papel

Análisis del presupuesto del Ministerio del Interior (2008)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ, S.
Asesoría
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restringida

Número de páginas: 49
Duración: 2 meses
Institución financiadora: Ministerio del Interior
Palabras clave: presupuesto
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Presupuesto
Medio de divulgación: Papel

Estimación de la brecha de producto sectorial en Uruguay (2007)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ, S., ALVAREZ, I., DA SILVA, N.
Asesoría
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restringida

Número de páginas: 43
Duración: 1 mes
Institución financiadora: CEPAL-Oficina Montevideo
Palabras clave: filtros, brecha de producto, análisis espectral
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Predicción macroeconómica
Medio de divulgación: Papel

Medición de la productividad del trabajo en las empresas públicas (2007)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ,S.
Estudio técnico y propuesta metodológica para las empresas UTE,ANCAP,ANTEL,ANP
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restrita

Número de páginas: 200
Duración: 12 meses
Institución financiadora: UTE,ANCAP,ANTEL,ANP
Palabras clave: productividad
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -
Macroeconomía-Productividad
Medio de divulgación: Papel

Métodos univariados para la estimación de la brecha de producto en Uruguay. Parte I (2007)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ,S. , ALVAREZ,I. , DA SILVA,N.
Asesoría
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restrita

Número de páginas: 30
Duración: 1 mes
Institución financiadora: CEPAL-Oficina Montevideo
Palabras clave: componentes no observables,filtros lineales
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción
macroeconómica
Medio de divulgación: Papel

Métodos univariados para la estimación de la brecha de producto en Uruguay. Parte II (2007)

Asesoramiento
RODRÍGUEZ,S. , ALVAREZ,I. , DA SILVA,N.
Asesoría
País: Uruguay
Idioma: Español
Ciudad: Montevideo
Disponibilidad: Restrita

Número de páginas: 30
Duración: 1 mes
Institución financiadora: CEPAL-Oficina Montevideo
Palabras clave: filtros , brecha de producto,análisis espectral
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría -Predicción
macroeconómica
Medio de divulgación: Papel

OTRAS PRODUCCIONES

CURSOS DE CORTA DURACIÓN DICTADOS

Modelización ARIMA y extracción de señales (2008)

RODRÍGUEZ,S.
Perfeccionamiento
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Duración: 4 semanas

Lugar: Instituto Nacional de Estadística (INE)
Ciudad: Montevideo
Institución Promotora/Financiadora: Instituto Nacional de Estadística (INE)-Dirección General Impositiva (DGI)
Palabras clave: Modelización, predicción, extracción de señales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Predicción

Modelos de predicción (2007)

RODRÍGUEZ, S.
Extensión extracurricular
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Duración: 2 semanas
Lugar: CONAPROLE
Ciudad: Montevideo
Institución Promotora/Financiadora: CONAPROLE
Palabras clave: Modelización, predicción, extracción de señales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Predicción
Información adicional: Como parte de la transferencia de conocimientos elaborados durante el desarrollo del Convenio que se firmó entre el Instituto de Estadística y CONAPROLE se realizó un curso de formación y transferencia de conocimientos a un conjunto de empleados de la empresa que potencialmente utilizarían las herramientas de modelización desarrolladas.

Modelización ARIMA y extracción de señales (2006)

RODRÍGUEZ, S.
Perfeccionamiento
País: Uruguay
Idioma: Español
Tipo de participación: Docente
Duración: 4 semanas
Lugar: ABN AMBRO Bank
Ciudad: Montevideo
Institución Promotora/Financiadora: ABN AMBRO Bank
Palabras clave: Modelización, predicción, extracción de señales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría de series de tiempo
Información adicional: Se dictó un curso de perfeccionamiento vinculado a la modelización univariada de variables económicas a un conjunto de empleados del ABN AMBRO Bank.

DESARROLLO DE MATERIAL DIDÁCTICO O DE INSTRUCCIÓN

Notas de Series Cronológicas. Licenciatura de Estadística (2023)

RODRÍGUEZ, S.

País: Uruguay
Idioma: Español
Medio divulgación: Internet
Web: [Eva ccee](#)
Elaboración de notas de apoyo al curso de Series Cronológicas de la Licenciatura de Estadística de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración. UdelAR
Palabras clave: Modelización, predicción, extracción de señales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría de series de tiempo

Notas de apoyo del curso de Técnicas econométricas para el análisis de largo plazo de la Maestría de Historia Económica (2005)

RODRÍGUEZ, S.

País: Uruguay

Idioma: Español
Medio divulgación: Papel
Elaboración de material didáctico de apoyo al curso de Técnicas econométricas para el análisis de largo plazo
Palabras clave: modelos ARIMA, componentes no observables
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría de series de tiempo

PROGRAMAS EN RADIO O TV

¿Cuántos vendrán? Un verano inquietante. (2019)

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

Entrevista

País: Uruguay

Idioma: Español

Emisora: Radio CARVE

Fecha de la presentación: 08/10/2019

Tema: ¿Cuántos vendrán? Un verano inquietante.

Duración: 15 minutos

OTRA PRODUCCIÓN TÉCNICA

Modelos de series temporales adaptativos y robustos para predecir contagios y muertes por COVID-19 en Uruguay: Predicciones resultantes de los modelos de Castle, Doornik y Hendry (2021)

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

País: Uruguay

Idioma: Español

Web: https://iesta.fcea.udelar.edu.uy/wp-content/uploads/2021/02/Nota_tecnica_Reflexiones_en_tiempos_de_P

Lugar: IESTA, Montevideo

Institución Promotora/Financiadora: IESTA

Palabras clave: Predicción COVID-19 Uruguay

Modelos de series temporales adaptativos y robustos para predecir contagios y muertes por COVID-19: la respuesta de Castle, Doornik y Hendry (2020)

RODRÍGUEZ-COLLAZO, SILVIA

País: Uruguay

Idioma: Español

Web: <https://www.colibri.udelar.edu.uy/jspui/handle/20.500.12008/25413>

Lugar: IESTA, Montevideo

Institución Promotora/Financiadora: IESTA

Palabras clave: Modelos de predicción COVID-19

Evaluaciones

EVALUACIÓN DE PUBLICACIONES

COMITÉ EDITORIAL

Revista Uruguaya de Historia Económica (2012 / 2012)

Cantidad: Menos de 5

Participación como evaluadora del manuscrito original enviado a la Revista Uruguaya de Historia Económica titulado: ANÁLISIS DE LAS MEDIDAS DEL PRODUCTO INTERNO BRUTO DE URUGUAY PARA EL PERÍODO 1870-1955.

Programa de Apoyo a Publicaciones CSIC (2011 / 2011)

Cantidad: Menos de 5

Integrante del comité de Referato del Programa de Apoyo a Publicaciones CSIC por la Facultad de Ciencias Económicas y de Administración.

EVALUACIÓN DE EVENTOS Y CONGRESOS

4th ELAEE Conference (2013 / 2014)

Revisiones

Uruguay

ADME,MIEM,Uruguay Natural,ANCAP, Universidad de la República,UTE, IBP

Integrante del Comité Académico de la 4ta Conferencia ELAEE

EVALUACIÓN DE CONVOCATORIAS CONCURSABLES

Programa de apoyo a publicaciones (2011 / 2011)

Uruguay

Cantidad: Menos de 5

Comisión Sectorial de Investigación Científica (CSIC)

El Programa de Apoyo a Publicaciones se propone colaborar a la difusión de los resultados de actividades de investigación universitaria en sus más diversas modalidades. La evaluación se aplicó a dos tipos de modalidades de publicación: fascículos o libros producidas por investigadores en el marco de su actividad académica en la Universidad y Números monográficos de revistas.

Formación de RRHH

TUTORÍAS CONCLUIDAS

POSGRADO

Estimación de la elasticidad precio e ingreso de la demanda mensual de GLP en Uruguay

Tesis de maestría

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ingeniería , Uruguay

Programa: Maestría en Ingeniería (Ingeniería Matemática)

Tipo de orientación: Cotutor en pie de igualdad

Nombre del orientado: Nora Gesto

País: Uruguay

Palabras Clave: demanda de GLP, Uruguay cointegración, modelo de corrección del error VEC en R program

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Modelos de demanda de energéticos

GRADO

Componentes variables del IPC: Frutas y Verduras

Tesis/Monografía de grado

Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay

Programa: Licenciatura en Estadística

Tipo de orientación: Tutor único o principal

Nombre del orientado: Margarita Guenaga

País: Uruguay

Palabras Clave: predicción inflación, componente frutas y verduras

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de Coyuntura y Predicción

Resumen En el presente trabajo se intenta encontrar modelos de series de tiempo estacionales intervenidos (ARIMA-IA) para predecir los precios de los grupos frutas y verduras (FV) del IPC de Uruguay. Para esto, se sigue como estrategia modelar las series utilizando la metodología Box-Jenkins, donde se recurre a un variado instrumental (tests y gráficos) de modo de poder identificar los modelos para luego estimarlos, validarlos y finalmente utilizarlos para predecir. En particular, se busca probar si existen ganancias, en cuanto al poder predictivo, en estimar los grupos FV

desagregados en cada uno de sus productos o conformando subgrupos, frente a estimarlos directamente. Luego se combinan los pronósticos obtenidos y se evalúan utilizando como criterios diversas medidas de error de predicción. De esta manera, se llega a que la desagregación en productos o la formación de subgrupos y la combinación en forma de promedio simple de estos, son las mejores opciones para minimizar el error de acuerdo a las medidas planteadas.

Modelización univariada de las llamadas entrantes diarias a un call center

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Cea,Gastón
País: Uruguay
Palabras Clave: modelos ARIMA,series diarias,R project
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Estimación del número de visitantes que podría ingresar a Uruguay y caracterización del perfil de los turistas ingresados en 2008

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Florencia Bacigalupi-Ana Rosenbaum
País: Uruguay
Palabras Clave: turismo receptivo, modelización ARIMA
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo -Predicción modelos ARIMA

Estimación de la brecha de producto mediante filtros lineales

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Alvarez,I-daSilva,N.
País: Uruguay
Palabras Clave: análisis espectral
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Modelización automática de series diarias de actividad económica

Tesis/Monografía de grado
Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración , Uruguay
Programa: Licenciatura en Estadística
Nombre del orientado: Cilintano,Santiago
País: Uruguay
Palabras Clave: modelos ARIMA,series diarias
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Otros datos relevantes

PRESENTACIONES EN EVENTOS

Primer Jornada de Política Fiscal y Tributaria (2022)

Encuentro
Implicaciones metodológicas del ajuste cíclico del resultado fiscal
Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 4
Nombre de la institución promotora: Centro de Investigaciones Económicas (CINVE)
Alcance geográfico: Local Palabras Clave: REglas fiscales brecha de producto estimaciones en tiempo real revisión de estimaciones componentes no observables
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series Temporales

VII Jornadas Nacionales de Estadística (2022)

Congreso
Diversas fuentes de revisión en las estimaciones de la posición cíclica de Uruguay mediante la aplicación de filtros
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Sociedad Uruguaya de Estadística, SUE
Alcance geográfico: Nacional Palabras Clave: Ciclo Hodrick Prescott Christiano Fitzgerald
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Extracción de señales

Jornadas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas (2022)

Congreso
¿De dónde venimos?: Hitos históricos de FCEA
Uruguay
Tipo de participación: Moderador
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración, Universidad de la República
Alcance geográfico: Nacional Presentación a cargo de los ex-decanos y decano actual de la Facultad de Ciencias Económicas y de Administración: Danilo Astori, exdecano de FCEA, Miguel Galmes, exdecano de FCEA, Rodrigo Arim, rector de la Universidad de la República y exdecano de FCEA, Jorge Xavier, actual decano de la Facultad de Ciencias Económicas y de Administración. Moderador: Silvia Rodríguez Collazo, Profesora Agregada G4 del Instituto de Estadística, (IESTA) FCEyA, UdelAR

International conference on Time Series and Forecasting, ITISE (2021)

Congreso
The ITISE 2021 (7th International conference on Time Series and Forecasting) seeks to provide a discussion forum for scientists, engineers, educators and students about the latest ideas and realizations in the foundations, theory, models and applications for interdisciplinary and multidisciplinary research encompassing disciplines of computer science, mathematics, statistics, forecaster, econometric, etc, in the field of time series analysis and forecasting.
España
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Universidad de Granada, CITIC-UGA, Facultad de Ciencias
Universidad de Granada, ATC
Alcance geográfico: Internacional Palabras Clave: Non-linear time series models Daily time series Electricity Climatic Variables
Areas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series Temporales

Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística, CLATSE "Laura Nalbarte" (2021)

Congreso
El XIV CLATSE es organizado por la Sociedad Uruguaya de Estadística y se realizará en modalidad virtual desde el 18 al 21 de Octubre de 2021. El congreso se compondrá de cursos, conferencias, sesiones/mesas invitadas y presentaciones orales.
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Nombre de la institución promotora: Sociedad Uruguaya de Estadística
Alcance geográfico: Internacional Palabras Clave: Brecha de producto ciclo Filtro Hodrick Prescott Filtro Baxter y King Filtro Cristiano Fitzgerald Filtros pasabanda

Jornadas Anuales de Economía, Banco Central del Uruguay (2017)

Congreso
Incertidumbre sobre el pasado y su influencia sobre la incertidumbre futura
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 1
Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: PIB Uruguay data vintage proceso de revisión de datos

Jornadas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2017)

Encuentro
Tendencias comunes en el proceso de medición de datos del IVF del PIB de Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 1
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: tendencias comunes data vintage Proceso de medición de datos

Jorandas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2016)

Encuentro
INCERTIDUMBRE SOBRE EL PASADO Y SU INFLUENCIA SOBRE LA INCERTIDUMBRE FUTURA
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 5
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: error de predicción revisión en los datos Cuentas Nacionales
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Predicción Macroeconómica

Jorandas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2016)

Encuentro
The long-run relationship between economic growth and passenger air transport in four South American countries
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 5
Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: air transport and growth nonlinear co-integration non-parametric causality test
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Economía del Turismo
Autores del trabajo: Juan Gabriel Brida , Bibiana Lanzilotta , Silvia Rodríguez , Sandra Zapata-Aguirre

Difusión de los Proyectos del Fondo Sectorial de Energía ANII (2015)

Otra
MODELOS DE PREDICCIÓN DE ENERGÍA ELÉCTRICA CON DATOS HORARIOS PARA URUGUAY
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 2
Nombre de la institución promotora: DNE-Ministerio de Industria y Energía Palabras Clave: Modelos de predicción Energía eléctrica

Seminario interno del CINVE (2014)

Seminario
Modelos de predicción de energía eléctrica con datos horarios para Uruguay
Uruguay
Tipo de participación: Expositor oral
Carga horaria: 2
Nombre de la institución promotora: CINVE Palabras Clave: Predicción, energía eléctrica, demanda horaria
Áreas de conocimiento:
Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta

frecuencia

Jorandas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2014)

Congreso

Predicción y estacionalidad intradiaria de la demanda de energía eléctrica en Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras

Clave: series alta frecuencia, estacionalidad múltiple

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta

frecuencia

Jorandas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2014)

Congreso

Long run relationship between economic growth and passenger air transport in Mexico

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras

Clave: nonlinear cointegration; nonparametric causality

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo no lineales

XXIX Jornadas Anuales de Economía (2014)

Congreso

Modelos de predicción de energía eléctrica con datos horarios para Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 2

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: Predicción de energía, modelos de alta frecuencia

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de tiempo alta

frecuencia

Terceras Jornadas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2012)

Congreso

¿ Estacionalidad determinística o estocástica en los componentes del producto?

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras

Clave: integración estacional, test HEGY, test C-H

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

Desde hace unos años se ha prestado especial atención a la caracterización de las propiedades estacionales de las series macroeconómicas, se discute si la mejor representación para la estacionalidad es a través de variables indicatrices o considerarla cambiante a través del tiempo. La forma más simple de filtrar la estacionalidad es mediante la incorporación de variables indicatrices, las que se suman al modelo de modo de aislar el componente estacional. Esta modalidad implica sostener que la estacionalidad de la serie es de carácter determinístico. Otra forma usual de filtrar la estacionalidad es mediante la diferencia estacional. Este filtro supone la presencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales y en la frecuencia cero, se aplica con el objeto de convertir a la serie filtrada en estacionaria. En este marco, surgen diferentes tests para contrastar la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales, entre ellos se encuentran los propuestos por Canova y Hansen (1995) y Hylleberg, Engle, Granger y Yoo, HEGY (1990). Estos tests se instrumentan a partir de hipótesis nulas completamente diferentes, en el test propuesto por Canova-Hansen, la hipótesis nula es que la estacionalidad del proceso es de tipo determinística, mientras que en el test de Hylleberg, Engle, Granger y Yoo la hipótesis nula es que el proceso contiene raíces unitarias en las frecuencias estacionales. El objetivo del trabajo es caracterizar la estacionalidad de la serie de índice de volumen físico del producto bruto interno de Uruguay (IVF PBIU) y sus componentes. Se considera la serie desagregada por industrias. Mediante la aplicación

de dos tipos de test, HEGY y Canova-Hansen se pretende obtener una primer caracterización de las propiedades estacionales de estas series. El análisis empírico se realiza sobre la serie armonizada de índice de volumen físico del producto bruto interno (IVF PBI) de Uruguay con base en el año 2005 y el producto desagregado por industrias elaboradas 1997-2011 publicadas por el Banco Central del Uruguay (BCU) todas ellas de frecuencia trimestral. En términos generales los resultados de los test muestran diferencias, excepto en la serie de producto industrial, donde ambos test rechazan la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales. En el caso del IVF PBIU agregado ambos test dieron en los resultados para todas las frecuencias. Estos test son de carácter complementario, si ambos test dan el mismo resultado, se puede tener mayor confianza en los resultados, si dieron se requiere de un análisis más profundo y considerar más información para definir la caracterización.

X Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística (2012)

Congreso

Caracterización de la estacionalidad de los componentes del PIB Uruguayo

Uruguay

Tipo de participación: Otros

Nombre de la institución promotora: CONGRESO LATINOAMERICANO DE SOCIEDADES DE ESTADÍSTICA Palabras Clave: Estacionalidad, Test HEGY, Test C-H

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

El presente documento describe la metodología y los resultados para la caracterización de la estacionalidad en las series económicas trimestrales de los componentes del gasto del PBI comprendidas entre los años 1988 y 2011. Las metodologías empleadas son las de Hylleberg et al y Canova Hansen. Ambos tests son complementarios en el sentido en que la hipótesis nula del primero de ellos postula la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales, mientras que el segundo parte del supuesto de que los ciclos estacionales son determinísticos. Adicionalmente, dado un cambio en la metodología de construcción de las series, se considera el tratamiento de un quiebre en la estacionalidad. Los resultados indican que, pese a que en primera instancia se pudo pensar en la existencia de raíces unitarias en las frecuencias estacionales en algunas series, esta conclusión se desvanece al incluir variables de regresión que capten el efecto del cambio de metodológico.

XXVII Jornadas Anuales de Economía (2012)

Congreso

Persistencia inflacionaria y pass through salarial: diagnóstico y causalidad

Uruguay

Tipo de participación: Otros

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay (BCU) Palabras Clave:

Persistencia inflacionaria, pass through salarial

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series Temporales

La formación de precios y la persistencia inflacionaria son elementos claves para el correcto diagnóstico de las presiones y las decisiones derivadas de política monetaria en pos de la estabilidad de precios. En economías como la uruguaya es clave entender el rol del traslado de salarios a precios para poder comprender y analizar tanto los cambios como la dinámica de la inercia inflacionaria. Este artículo estudia la causalidad entre persistencia inflacionaria y la dinámica del traslado a precios de los salarios en Uruguay desde fines de los 90 hasta la actualidad, a partir de estimaciones rolling de ambas variables. Los resultados permiten afirmar que el nivel de pass through salarial juega un rol importante en el nivel de persistencia inflacionaria, pudiéndose identificar causalidad en el sentido de Granger desde el pass through salarial hacia la persistencia inflacionaria.

Primeras Jornadas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2011)

Congreso

Revisión en las series desestacionalizadas por X-12 ARIMA y SEATS. Aplicación a la serie armonizada de Medios de pago del MERCOSUR.

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: Desestacionalización, X-12 ARIMA

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de la coyuntura

El proceso de estimación de los componentes inobservables viene ineludiblemente asociado a la revisión de las estimaciones. En este trabajo se cuantifica y analiza la magnitud y duración de las revisiones en los componentes inobservables estimados, resultado de aplicar las dos metodologías. Se cuantifican las revisiones en los datos estimados cuando se sustituye el dato predicho de la serie original o agregada, por el dato efectivamente observado.

Congreso Latinoamericano de Sociedades de Estadística (CLATSE IX) (2010)

Congreso

Modelos estocásticos para predecir la demanda de gas licuado de petróleo en Uruguay

Chile

Tipo de participación: Otros Palabras Clave: ARIMA, ECM, gas licuado de petróleo, predicción

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, Predicción corto plazo

Jornadas Académicas de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración (2010)

Congreso

Temperatura y desempeño predictivo de los modelos de demanda de GLP. Análisis de Sensibilidad Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Carga horaria: 4

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: ARIMA, ECM, gas licuado de petróleo, predicción

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Análisis de la coyuntura

El objetivo de este trabajo es obtener pronósticos de la demanda del producto a diferentes horizontes de predicción y analizar la sensibilidad de dichos pronósticos al incorporar como variable exógena la temperatura. Se utilizan modelos univariados (SARIMA-IA) con frecuencia diaria y mensual. Al incorporar la variable exógena temperatura en el modelo diario se concluye, que el error de predicción no disminuye a pesar de ser esta variable significativa. Esto puede ser explicado por la alta frecuencia de los datos, que le da flexibilidad al modelo sin requerir la incorporación de esta variable. En cambio en los datos con frecuencia mensual la temperatura juega un rol importante en la mejora de la performance predictiva en los primeros meses de frío. Los modelos presentados son complementarios en lo que a horizontes de predicción se refiere.

XXIII Jornadas Anuales de Economía (2008)

Congreso

Jornadas Anuales de Economía. Banco Central del Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: brecha de producto, filtros lineales

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Congreso Latinoamericano de Estadística-CLATSE VIII (2008)

Congreso

Octavo Congreso Latinoamericano de Estadística-CLATSE

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: brecha de producto, producto potencial

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Violencia, Inseguridad y Miedos en el Uruguay (2006)

Encuentro

Violencia, Inseguridad y Miedos en el Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: FESUR Palabras Clave: componentes no

observables, predicción

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

XIX Jornadas Anuales de Economía (2004)

Congreso

Jornadas Anuales de Economía. Banco Central del Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: ciclos, asimetrías

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

XVIII Jornadas Anuales de Economía (2003)

Congreso

Jornadas Anuales de Economía. Banco Central del Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: Escalas de equivalencia

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Quinto Congreso Latinoamericano de Estadística-CLATSE V (2002)

Congreso

Congreso Latinoamericano de Estadística-CLATSE

Argentina

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Universidad Tres de Febrero. Buenos Aires, Argentina

Palabras Clave: quiebres, test raíz unitaria

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Jornadas de Economía y Empleo en Uruguay (2001)

Congreso

Jornadas de Economía y Empleo en Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Facultad de Ciencias Económicas y Administración Palabras Clave: quiebres, test raíz unitaria

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

(1998)

Congreso

Jornadas Anuales de Economía. Banco Central del Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Palabras Clave: Paridad de Poder de Compra, PPP

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

XIII Jornadas Anuales de Economía (1998)

Congreso

Jornadas Anuales de Economía. Banco Central del Uruguay

Uruguay

Tipo de participación: Expositor oral

Nombre de la institución promotora: Banco Central del Uruguay Palabras Clave: ARIMA, tasa de

desempleo, predicción

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

JURADO/INTEGRANTE DE COMISIONES EVALUADORAS DE TRABAJOS ACADÉMICOS

Ajustes de modelos dinámicos aplicados a recursos pesqueros (2012)

Candidato: Brito, Fernando y Saravia, María.

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ, S.

Licenciatura en Estadística / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

¿Es Uruguay caro en relación a otros países? Alimentos y bebidas en comparación internacional, evolución y determinantes (2012)

Candidato: Díaz, Alejandro

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ, S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Persistencia del desempleo en Uruguay (2011)

Candidato: Santiago Bianchi-Martin Hansz-Marcelo Rubido

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ, S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: persistencia, desempleo, negociación colectiva

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Índice de precios de exportaciones agropecuarias 1999-2009 (2011)

Candidato: Consolandi Gimena-Ferreira Pablo-Fierro Lucía

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ, S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: Índice de precios, cointegración, commodities

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría

Construcción de un indicador adelantado para el IVF de la Industria Manufacturera mediante Random Forests (2011)

Candidato: Estefanía Gómez Galimberti

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ, S.

Licenciatura en Estadística / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: indicador adelantado, random forests

La conflictividad laboral en el Uruguay: análisis de sus principales determinantes en el período 1995-2008 (2010)

Candidato: María Olivieri-Laura Zacheo

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: conflictividad laboral, causalidad Granger

Construcción de un Índice líder sintético para la industria uruguaya (2009)

Candidato: Marín Fossati - Juan Moreda

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: Índice líder, industria

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Series de Tiempo, indicadores adelantados

Algunas medidas de inflación subyacente (2009)

Candidato: Nario,Diana-Antoine,Andrés

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: inflación subyacente

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Modelación del precio del petróleo (2009)

Candidato: Magnou,Guillermo-Marziotte,Leticia

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Estadística / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: Modelos GARCH,R project

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Estimación de la demanda de combustibles (2008)

Candidato: Negro,Magela

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Estadística / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República / Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: demanda de combustibles,ARIMA,VAR

Áreas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Econometría-Series de Tiempo

Política fiscal y crecimiento económico. El caso Uruguayo (2008)

Candidato: Panizza,Aan Inés-Rodríguez,Soledad

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: VEC,poltica fiscal,determinantes del PBI

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Sensibilidad de la demanda laboral ante cambios en las variables que la determinan. Uruguay: 1986-2005 (2008)

Candidato: Melognio,Elena-Porras,Sylvina

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: elasticidad de la demanda laboral,

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Impacto de las fluctuaciones del tipo de cambio real sobre los sectores productivos.1985-2006 (2008)

Candidato: Cobas,Adriana-García, Ana Laura

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: Modelo de Corden Neary,VEC

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Modelos SARFIMA diarios no estacionarios (2007)

Candidato: Giacometti, Mauricio

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: predicción,diferenciación fraccional

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

Vinculación, contagio y absorción de shocks en bloque regional con alta vulnerabilidad macroeconómica (2006)

Candidato: Silvina Panizza

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: vulnerabilidad económica

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría - Macroeconomía

Dinámica no lineal de la tasa de desempleo de Montevideo. Una aplicación con modelos TAR (2003)

Candidato: Gramoso Daniel

Tipo Jurado: Tesis/Monografía de grado

RODRÍGUEZ,S.

Licenciatura en Economía / Sector Educación Superior/Público / Universidad de la República /

Facultad de Ciencias Económicas y de Administración / Uruguay

País: Uruguay

Idioma: Español

Palabras Clave: modelos TAR,tasa de desempleo

Areas de conocimiento:

Ciencias Sociales / Economía y Negocios / Economía, Econometría / Econometría de Series de Tiempo

CONSTRUCCIÓN INSTITUCIONAL

Actuación en política universitaria de la Universidad de la República: en 2010 parte de la Asamblea del Claustro de Facultad de Ciencias Económicas y Administración (FCyA). Actividades de co-gobierno: Formé parte de la Comisión de Dirección del Instituto de Estadística de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración hasta el inicio del proceso de departamentalización. Actualmente, parte del Consejo de dirección del Departamento de Métodos Cuantitativos de la FCyA en carácter de suplente.

Información adicional

Tribunales de Concursos. Facultad de Ciencias Económicas y Administración

1. Llamado a CONCURSO ABIERTO DE MÉRITOS Y PRUEBAS para la provisión EFECTIVA del cargo de Profesor Adjunto G°3 (perfil Profesional) del Departamento de MÉTODOS CUANTITATIVOS (LLOA central).

Tribunal integrado por: Gabriel Brida (Profesor titular G°5), Gabriel Camaño (Profesor Agregado G°4) y Silvia Rodríguez Collazo (Profesor Agregado G°4). Integración designada por el Consejo de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración.

El Concurso concluido.

2. Llamado concurso abierto de méritos y pruebas para la provisión efectiva de dos cargos de Profesor Adjunto (perfil profesional) para el Departamento de Administración, Unidad Académica Marketing.

Tribunal integrado por: José Camacho (Profesor Adjunto G°3), Antonio Fraga, Silvia Rodríguez

Collazo (Profesor Agregado G°4). Integración designada por el Consejo de la Facultad de Ciencias Económicas y Administración.

El Concurso concluido.

Indicadores de producción

PRODUCCIÓN BIBLIOGRÁFICA	39
Artículos publicados en revistas científicas	6
Completo	6
Trabajos en eventos	7
Libros y Capítulos	3
Libro publicado	1
Capítulos de libro publicado	2
Textos en periódicos	4
Revistas	4
Documentos de trabajo	19
Completo	19
PRODUCCIÓN TÉCNICA	16
Trabajos técnicos	8

Otros tipos	8
EVALUACIONES	4
Evaluación de eventos	1
Evaluación de publicaciones	2
Evaluación de convocatorias concursables	1
FORMACIÓN RRHH	6
Tutorías/Orientaciones/Supervisiones concluidas	6
Tesis/Monografía de grado	5
Tesis de maestría	1