



Departamento de
Estadística e
Investigación Operativa

CICLO DE CONFERENCIAS ESTADÍSTICA Y CIENCIA DE DATOS PATRICIA ROMÁN

13/05/2026

Título: Modelización y análisis de variables de tipo económico mediante procesos de difusión. El caso de Colombia.

Fecha y hora: 22 de mayo del 2026 (12.30 horas).

Lugar (CAMBIO por obras): Sala de Conferencias del IMAG, UGR.

Conferenciante: Arnold de la Peña Cuao (Departamento de Estadística e I.O. Universidad de Granada).



Resumen:

El modelado de variables económicas dinámicas es un área de investigación en constante evolución que abarca diversos temas económicos. Este estudio modela el índice de consumo (IPC) básico en Colombia utilizando el proceso de difusión log-normal no homogéneo con factores exógenos lineales. La metodología combina un procedimiento bayesiano para la selección de factores exógenos que identificó cinco variables clave, con la estimación por máxima verosimilitud de los parámetros del modelo que permiten la obtención de expresiones analíticas para las características principales del proceso y la función de densidad de probabilidad del estimador de la media condicional. Los resultados muestran que el modelo supera las proyecciones del Banco Central en múltiples horizontes temporales, capturando el repunte inflacionario post-pandemia y post-invasión a Ucrania de 2022. El análisis de escenarios revela que las tasas de interés y la política monetaria son los principales factores que influyen en el IPC, seguidos por el sector externo y el mercado laboral.

<http://estadistica.ugr.es/>

Este enfoque representa un avance significativo para economías emergentes susceptibles a choques internos y externos, proporcionando herramientas analíticas robustas para la toma de decisiones de política monetaria.

La conferencia **se emitirá en directo** en el canal de youtube del departamento:
<https://www.youtube.com/live/34nC63sOmQQ>