

PRESENTACIÓN

RIGOBERTO PÉREZ SUÁREZ^a, ANA JESÚS LÓPEZ MENÉNDEZ^a

^a *Universidad de Oviedo, Facultad Economía y Empresa, Avda. del Cristo, s/n, 33006 Oviedo, España. E-mail: rigo@uniovi.es, anaj@uniovi.es*

La predicción económica es una actividad tan apasionante como controvertida. A pesar del consenso generalizado sobre su necesidad, existe un amplio debate sobre la idoneidad de las técnicas y métodos para elaborar predicciones, las medidas para evaluar su precisión e incluso el papel que los organismos de prospectiva deben desempeñar en un entorno socioeconómico cambiante e incierto.

Todos estos temas han sido abordados en el presente número monográfico “Predicción económica: métodos y herramientas”, elaborado como homenaje al profesor Antonio Pulido San Román y que pretende reconocer su indudable contribución al desarrollo de la predicción económica en nuestro país.

El número comienza con una contribución del propio Antonio Pulido, que aporta su visión de experto sobre el pasado y el futuro de la predicción en el ámbito económico. Bajo el título “La predicción en Economía: Posibilidades y limitaciones”, Antonio Pulido realiza una revisión crítica del pasado de la predicción económica y empresarial y plantea reflexiones de futuro, insistiendo en la especial dificultad de esta tarea en un entorno caracterizado por la volatilidad, la incertidumbre, la complejidad y la ambigüedad.

A continuación, los profesores Milagros Dones y Julián Pérez, de la Universidad Autónoma de Madrid, describen en su contribución la trayectoria académica del profesor Antonio Pulido, de quien ambos son discípulos. Los epígrafes dedicados a metodología econométrica, modelos aplicados, economía regional, Input-output, Universidad e I+D+i, análisis y prospectiva económica y otras áreas de interés permiten revisar la extensa obra publicada por Antonio Pulido quien, en palabras de los propios autores, constituye “historia viva de la Economía Aplicada en España”.

Además de las dos contribuciones anteriormente descritas, el monográfico incluye seis artículos de investigación que han superado el proceso de doble evaluación anónima por expertos. Los trabajos van referidos a la evaluación de predicciones, la comparación de técnicas predictivas, el análisis de la dependencia espacial en la estimación de valores añadidos, y la elaboración y análisis de predicciones en distintos ámbitos como el demográfico, el actuarial y el tráfico aeroportuario de pasajeros.

En el primero de los artículos, titulado “Evaluación del sesgo en las estimaciones de Contabilidad Nacional Trimestral: Estudio de las añadas en España”, los profesores Bernardí Cabrer, Guadalupe Serrano y José Manuel Pavía, de la Universidad de Valencia, llevan a cabo una evaluación de la calidad y precisión de las predicciones de Contabilidad Nacional Trimestral de España, analizando la posible existencia de discrepancias sistemáticas entre los avances (primera predicción) de cada trimestre y el último dato publicado para el mismo. Este estudio de las añadas permite a los autores analizar la influencia del contexto económico en los errores, detectando que en los periodos recesivos de la economía se observa una mayor discrepancia entre el primer avance de la tasa de variación del PIB y la última estimación disponible que se considera definitiva, mientras, en los periodos expansivos y de estabilidad económica dichas discrepancias son claramente menores.

En el ámbito del análisis de precisión de predicciones se enmarca también el trabajo “*Forecasting Performance and Information Measures. Revisiting the M-Competition*”, de los profesores Ana Jesús López y Rigoberto Pérez, de la Universidad de Oviedo. Este artículo analiza dos indicadores de precisión basados en medidas de información (el índice de Theil y la medida cuadrática de precisión QIAM), cuya aplicación a la M-Competición permite reexaminar los resultados empíricos obtenidos globalmente y más concretamente para las series macroeconómicas y financieras, analizando las coincidencias y discrepancias con las conclusiones obtenidas por Makridakis y Hibon a partir de cinco medidas de precisión basadas en errores.

El trabajo de los profesores José Daniel Buendía y María del Mar Sánchez De la Vega, de la Universidad de Murcia lleva por título “Estimación del valor añadido bruto, dependencia espacial y datos de panel: Evidencia en el caso de los municipios de la región de Murcia” y propone una metodología para la estimación del Valor Añadido Bruto por habitante en el ámbito geográfico municipal. El procedimiento utilizado por los autores consiste en estimar un modelo de panel que captura la dependencia espacial mediante la inclusión del filtro de Griffith, y permite estimar y predecir de forma robusta el Valor Añadido Bruto por habitante de los municipios de la Región de Murcia.

La proyección de la mortalidad en España es el objetivo del artículo de Andrés Gustavo Benchimol, de la Universidad Carlos III de Madrid y la OBS

Business School. Bajo el título “Proyección de mortalidad en España mediante mixturas de modelos y análisis del impacto económico del riesgo de longevidad”, este trabajo utiliza datos de mortalidad de España y emplea cuatro de los modelos de proyección de mortalidad más difundidos en la literatura actuarial, concluyendo que la mixtura de modelos es adecuada para proyectar las tasas centrales de mortalidad, por lo que su uso podría mitigar el riesgo de longevidad y las pérdidas económicas asociadas al mismo.

El riesgo de mortalidad y longevidad es también objetivo del trabajo “Una herramienta de cálculo para la predicción de los Requerimientos de Capital en seguros de vida” de los profesores José Manuel Pavía y Ernesto Veres, de la Universidad de Valencia. Los autores ponen de manifiesto el potencial de una técnica predictiva sencilla, basada en hipótesis realistas, que cuantifica el capital de solvencia obligatorio y muestran cómo agrupando el total de pólizas de una cartera a partir de la edad del asegurado y/o la temporalidad es posible predecir el capital requerido de solvencia para una cartera y un riesgo determinados a través de una función lineal.

Por último, el artículo de los profesores Ana María López, Mario A. Flores y Juan Ignacio Sánchez de la Universidad Autónoma de Madrid lleva por título “Modelos de series temporales aplicados a la predicción del tráfico aeroportuario español de pasajeros: Un enfoque agregado y desagregado”. Este trabajo se centra en el uso de modelos ARIMA para la predicción del tráfico aeroportuario de pasajeros en España, examinando en qué medida el poder predictivo de esta magnitud en términos agregados puede ser mejorado mediante el uso de información más detallada e individualizada, a través de un enfoque desagregado, procedente de la suma de las predicciones realizadas para los diferentes aeropuertos regionales.

Todos estos trabajos constituyen una muestra del amplio abanico de investigaciones relacionadas con la predicción económica y, como hemos señalado anteriormente, pretenden servir de homenaje a Antonio Pulido a quien debemos agradecer no sólo el impulso científico a este campo sino también su incansable trabajo de divulgación, su capacidad de liderazgo de equipos universitarios y su contagiosa ilusión por emprender nuevos retos.

Gracias Antonio, por haber conseguido que la predicción, siendo una actividad de *alto riesgo*, se haya convertido también en una experiencia *altamente gratificante*, capaz de proporcionarnos tantas satisfacciones en estos años compartidos contigo.

