

Pronósticos de corto plazo en tiempo real para la actividad económica colombiana

Borradores de Economía

Número:

724

DOI:

<http://doi.org/10.32468/be.724>

Publicado:

Sábado, 14 Enero 2012

Clasificación JEL:

C22, C53, E27

Palabras clave:

crecimiento del producto, pronóstico en tiempo real, modelo de factores dinámicos.

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

La toma de decisiones de política económica requiere estimaciones del comportamiento de la actividad económica en tiempo real. Sin embargo, la información utilizada solo está disponible a nivel de indicadores de actividad y de encuestas de opinión, los cuales suelen tener distintas frecuencias y rezagos de publicación, además de choques idiosincráticos. En este trabajo se adaptan para la economía colombiana los esquemas de pronóstico de Camacho y Perez-Quiros (2009,2010) que producen estimaciones del crecimiento del PIB en tiempo real. El modelo de factores dinámicos adaptado involucra series de actividad de diferente frecuencia, disponibilidad y procedencia, empleadas con la información disponible en el momento de cada publicación. La evaluación de pronóstico sugiere que el modelo presenta un mejor desempeño frente a otros esquemas de referencia, y que la precisión de los pronósticos aumenta al incorporar el flujo de información en tiempo real de los indicadores de actividad.