Pronósticos de agregados a partir de desagregados Caso empírico: Inflación de alimentos en Colombia

Borradores de Economia
Número:
504
Publicado:
Martes, 1 Abril 2008
Clasificación JEL:
C53, C81, E31, E37
Palabras clave:
Inflacion de alimentos, desagregacion, metodos de clasificacion de variables, pronosticos.
Descargar documento

Lo más reciente

Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Otras Publicaciones

Pronosticar la inflación de alimentos es uno de los grandes retos del Banco central, debido a la alta ponderación de los alimentos dentro del IPC y puesto que los rubros que conforman este grupo obedecen principalmente a factores de oferta que no son fácilmente predecibles ni reaccionan a la política monetaria. En este trabajo se construyen pronósticos para la inflación de alimentos a partir de desagregados, utilizando diferentes clasificaciones de la canasta de alimentos del IPC. Se evalúan y comparan modelos tanto univariados como multivariados según su capacidad de pronóstico. Los resultados muestran, que los pronósticos construidos a partir de pronósticos de subgrupos de alimentos generados por modelos multivariados (VARX y VEC) producen menor error de pronóstico que los generados por un modelo univariado (ARX). De otro lado, para el corto y mediano plazo, los pronósticos para el agregado construidos agregando pronósticos de subgrupos de alimentos producen menor error de pronóstico que los pronósticos para la inflación de alimentos generados por un modelo que contiene tanto rezagos del agregado como rezagos de los subgrupos. Sin embargo, para horizontes más lejanos los segundos parecen mejores que los primeros.