Pronósticos de agregados a partir de desagregados Caso empírico: Inflación de

Pronósticos de agregados a partir de de los desagregados 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. <u>Descargar documento</u>

Lo más reciente

Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen

Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

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.

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