

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

Borradores de Economía

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

[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](#)

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