Cuantificación de encuestas ordinales y pruebas de racionalidad: una aplicación a la encuesta mensual de expectativas económicas

Borradores de Economia
Número:
649
Publicado:
Viernes, 1 Abril 2011
Clasificación JEL:
C01, C12, C83
Palabras clave:
Encuestas de expectativas, Métodos de cuantificación, Expectativas racionales, Mínimos cuadrados generalizados
Descargar documento

Lo más reciente

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
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
Otras Publicaciones

En este artículo se cuantifican las respuestas cualitativas de la ?Encuesta Mensual de Expectativas Económicas (EEME)? a través de métodos de conversión tradicionales como la estadística del balance de Bachellier (1986), el método probabilístico propuesto por Carlson-Parkin (1975) y la propuesta de Análisis Cuantitativo Regional (ACR-2003). Para las respuestas analizadas de esta encuesta se encontró que el método ACR registra el mejor desempeño teniendo en cuenta su mejor capacidad predictiva. Esta cuantificación es posteriormente utilizada en pruebas de racionalidad de expectativas que requieren la verificación de cuatro hipótesis fundamentales: insesgamiento, correlación serial, eficiencia y ortogonalidad.