

Reglas de fijación de precios de los productores colombianos: evidencia a partir de los modelos de duración con micro datos del IPP

Reglas de fijación de precios de los productores colombianos: evidencia a partir de los modelos de duración con micro datos del IPP

Borradores de Economía

Número:

600

Publicado:

Sábado, 1 Mayo 2010

Clasificación JEL:

E31, E52, E58

Palabras clave:

Rigideces de precios, Funciones hazard semiparamétricas, Estadística bayesiana

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Dinámica Salarial, Desempleo e Inflación: Extendiendo el Modelo Semi-Estructural 4GM](#)

Mario Andrés Ramos-Veloza, Sara Naranjo-Saldarriaga, José Pulido

[Índices de Sentimiento e Incertidumbre de las noticias económicas de Colombia](#)

Rocío Clara Alexandra Mora-Quiñones, Antonio José Orozco-Gallo, Dora Alicia Mora-Pérez

[Billeteras móviles y otros servicios de pago: brechas regionales y su adopción en Colombia](#)

Constanza Martínez-Ventura, Ligia Alba Melo-Becerra

[Otras Publicaciones](#)

En este artículo se estudia la habilidad de las reglas de precios dependientes del tiempo y del estado para explicar la probabilidad de que las firmas Colombianas cambien los precios. Para este propósito, se utilizan los precios recolectados por el Banco de la República en el cálculo del Índice de Precios del Productor durante el periodo 06 de 1990 a diciembre de 2006. El análisis se basa en la metodología semiparamétrica de la función hazard constante por tramos, para verificar por la dependencia del tiempo, y en los modelos de duración de riesgos en competencia, que distingue entre incrementos y disminuciones de precios, para probar por la dependencia del estado. Adicionalmente, se controla la heterogeneidad realizando la estimación en cada uno de los 213 estratos homogéneos conformados. Los resultados se pueden resumir en: 1) Aproximadamente, un tercio de los estratos tienen reglas dependientes del tiempo. Adicionalmente, la función hazard de referencia de las rachas de precios no es decreciente en el 70% de los estratos. 2) Existe heterogeneidad en la forma, el nivel de la función hazard y en el impacto de la inflación sectorial acumulada sobre la probabilidad de cambiar los precios. 3) hay evidencia de dependencia del estado en el 60% de los casos en los que los precios disminuyeron. 4) Se observa asimetría en el efecto de la inflación sectorial acumulada sobre la probabilidad de cambiar los precios cuando se distinguen incrementos y disminuciones de precios

Reglas de fijación de precios de los productores colombianos: evidencia a partir de los modelos de duración con micro datos del IPP