El 'IMACO': un índice mensual lider de la actividad económica en Colombia

Borradores de Economia
Número:
609
DOI:
http://doi.org/10.32468/be.609
Publicado:
Jueves, 14 Enero 2010
Clasificación JEL:
E23, E27, E37
Palabras clave:
Indice lider, Ciclo económico, Componentes principales
Descargar documento

Lo más reciente

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
Otras Publicaciones

En este trabajo se describe la construcción de un nuevo indicador mensual líder de la actividad económica en Colombia (IMACO). El procedimiento se basa en un algoritmo de búsqueda heurístico que identifica siete variables líderes del nivel de actividad, que anticipan los movimientos del PIB con cinco meses de adelanto y una correlación del 93%. Asimismo, el IMACO tiene otras propiedades predictivas deseables: anticipa los puntos de quiebre del ciclo económico colombiano sin arrojar señales falsas, y minimiza los errores de pronóstico sobre el crecimiento del PIB. Dada su simplicidad y bajo costo computacional, el IMACO provee una herramienta para el seguimiento continuo de la coyuntura y el diseño de la política económica, que puede ser replicado tanto para otros agregados macroeconómicos en Colombia así como en otros países de la región.