

Una metodología multivariada de desagregación temporal

Borradores de Economía

Número:

586

Publicado:

Lunes, 1 Febrero 2010

Clasificación JEL:

C32, C51, E01

Palabras clave:

Desagregación temporal, Restricciones de agregación temporales y contemporáneas

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Revista Ensayos Sobre Política Económica - Explorando las brechas de género en Colombia](#)

María Teresa Ramírez-Giraldo, Karina Acosta, Olga Lucia Acosta Navarro, Lucia Arango-Lozano, Fernando Arias-Rodríguez, Oscar Iván Ávila-Montealegre, Oscar Reinaldo Becerra Camargo, Leonardo Bonilla-Mejía, Grey Yuliet Ceballos-García, Luz Adriana Flórez, Juan Miguel Gallego-Acevedo, Luis Armando Galvis-Aponte, Luis M. García-Pulgarín, Andrés Felipe García-Suaza, Anderson Grajales, Daniela Gualtero-Briceño, Didier Hermida-Giraldo, Ana María Iregui-Bohórquez, Juliana Jaramillo-Echeverri, Karen Laguna-Ballesteros, Francisco Javier Lasso-Valderrama, Daniel Márquez, Carlos Alberto Medina-Durango, Ligia Alba Melo-Becerra, María Fernanda Meneses-González, Juan José Ospina-Tejeiro, Andrea Sofía Otero-Cortés, Daniel Parra-Amado, Juana Piñeros-Ruiz, Christian Manuel Posso-Suárez, Natalia Ramírez-Bustamante, Mario Andrés Ramos-Veloz, Jorge Leonardo Rodríguez-Arenas, Alejandro Sarasti-Sierra, Bibiana Taboada-Arango, Ana María Tribín-Urbe, Juanita Villaveces

[Otras Publicaciones](#)

En este artículo se propone una extensión de la metodología multivariada de desagregación temporal de Di Fonzo [1990]. Esta supone que los errores de las series de alta frecuencia siguen un modelo VAR(1) en lugar de un proceso ruido blanco. Adicionalmente, se realiza una reseña de diferentes métodos de desagregación, tanto univariados como multivariados, incluyendo sus principales ventajas y desventajas. Finalmente, se lleva a cabo una aplicación multivariada para obtener las cuentas nacionales colombianas mensuales a partir de datos trimestrales.