Una metodología multivariada de desagregación temporal

Borradores de Economia
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

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 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.