

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

[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

[Subsidios a la nómina para las pymes en mercados laborales informales](#)

Leonardo Fabio Morales, Leonardo Bonilla-Mejía, Didier Hermida-Giraldo, Francisco Javier

Lasso-Valderrama, José Pulido

[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.