Choques internacionales reales y financieros y su impacto sobre la economía colombiana

Borradores de Economia
Número:
728
Publicado:
Miércoles, 1 Agosto 2012
Clasificación JEL:
C32, C51, E42
Palabras clave:
Modelos FAVAR, Transmisión internacional, Economia abierta, Identificación de choques
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 documento se utiliza la metodología FAVAR (factor augmented VAR) para evaluar el impacto de variaciones no esperadas en cuatro variables internacionales: las tasas de interés de corto plazo, el riesgo, el precio real del petróleo, el café y el carbón, y la actividad económica mundial. Se utilizan funciones de impulso respuesta y descomposición histórica de choques para evaluar la importancia de los factores externos en la actividad económica colombiana, con énfasis en la crisis de fin de siglo.