El Producto potencial utilizando el filtro de Hodrick-Prescott con parámetro de suavización variable y ajustado por inflación: una aplicación para Colombia - Portal En Petgalucto potencial utilizando el filtro

## de Hodrick-Prescott con parámetro de suavización variable y ajustado por inflación: una aplicación para Colombia

Borradores de Economia

**Número:** 

83

**Publicado:** 

Viernes, 12 Diciembre 1997

**Clasificación JEL:** 

C13, C22, E32

**Palabras clave:** 

Producto potencial, Filtro de Hodrick-Prescott, Inflación, Colombia <u>Descargar documento</u>

## Lo más reciente

<u>La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados</u> Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez

Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen

Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew

<u>Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un</u> modelo XGBoost

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

Otras Publicaciones

Utilizando parte de la teoría económica, en particular, la interpretación del ciclo económico como un fenómeno de desequilibrio temporal caracterizado por la demanda de la economía, se motiva una generalización natural del filtro de Hodrick y Prescott, admitiendo que el parámetro de suavización pueda cambiar en el tiempo. Esta metodología es aplicada al producto real de Colombia con el objeto de estimar su componente permanente o producto potencial, durante el período comprendido entre 1981: I y 1996: IV. La identificación y estimación de los parámetros de suavización del filtro generalizado se basa en dos procedimientos: primero, dado que el parámetro de suavización se puede interpretar como la razón entre las varianzas de choques de demanda y oferta, se utiliza un VAR estructural para estimar estos choques para la economía colombiana, y de esta forma mediante una estadística se ubican cambios estructurales sobresalientes, que permitan detectar cambios en el parámetro de suavización durante el período de análisis. Y segundo, una vez detectados los períodos en los cuales cambia el parámetro de suavización, entre un conjunto de valores posibles para estos parámetros, se escogen aquellos valores que definen el eroduate potentialide taliforma guanta tiena al meriprajuste da la inflación apual divendan variable y ajustado por inflación: una aplicación para Colombia

