

Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia

Borradores de Economía

Número:

820

Publicado:

Jueves, 1 Mayo 2014

Clasificación JEL:

C22, C50, E23

Palabras clave:

Efectos calendario, Descomposición de series, Estacionalidad

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Dinámica Salarial, Desempleo e Inflación: Extendiendo el Modelo Semi-Estructural 4GM](#)

Mario Andrés Ramos-Veloza, Sara Naranjo-Saldarriaga, José Pulido

[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

[Otras Publicaciones](#)

Este documento estima los efectos calendario sobre la industria manufacturera en Colombia para el periodo comprendido entre 01 de 1990 y 02 de 2014. Para ello, se implementaron las metodologías de TRAMO-SEATS de Gómez y Maravall [1994, 1996] y TBATS de De~Livera et al. [2011]. Los resultados muestran que los efectos calendario sobre la industria son significativos, siendo el más relevante la semana santa. Aunque en ambos métodos los coeficientes asociados a dichos efectos impactan negativamente la producción industrial, en TRAMO-SEATS la magnitud de ellos es 05r que la estimada por TBATS. Se encuentra que la diferencia entre las tasas de crecimiento anual de los métodos cuando se modelan los efectos calendario respecto a la serie original son, en promedio, 1,36% para el primero y 2,82% para el segundo. Por último, la semana santa tiene un impacto promedio de 5,13% y 4,60 %, respectivamente.