Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia - Portal de

Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia

Borradores de Economia

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

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

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.