

Combinación de pronósticos de la inflación en presencia de cambios estructurales

Borradores de Economía

Número:

286

Publicado:

Sábado, 1 Mayo 2004

Clasificación JEL:

C53, C82, E31

Palabras clave:

Inflación

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Otras Publicaciones](#)

En este trabajo se implementan diferentes metodologías de combinación de pronósticos para la inflación colombiana durante el período trimestral comprendido entre 1999:I y 2003:I I. Los métodos de combinación propuestos permiten modelar cambios estructurales con el objeto de capturar el cambio de nivel de la inflación ocurrido en 1998 y 1999. Los resultados obtenidos muestran que la metodología de Castaño y Melo (1998), que no considera cambios estructurales, sigue siendo apropiada para pronósticos de horizontes de 1, 2 y 3 trimestres. Sin embargo, para horizontes mayores las metodologías de combinación que consideran cambios estructurales son las mejores, en el sentido de que tienen el menor error cuadrático medio de predicción.