

Tendencias estocásticas comunes y fluctuaciones en la economía colombiana:  
1950-2002 - Portal de Investigaciones Económicas

# Tendencias estocásticas comunes y fluctuaciones en la economía colombiana: 1950-2002

Borradores de Economía

**Número:**

275

**Publicado:**

Domingo, 1 Febrero 2004

**Clasificación JEL:**

C32, E32

**Palabras clave:**

Tendencias estocásticas comunes, Fluctuaciones

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Revista Ensayos Sobre Política Económica - Explorando las brechas de género en Colombia](#)

María Teresa Ramírez-Giraldo, Karina Acosta, Olga Lucia Acosta Navarro, Lucia Arango-Lozano, Fernando Arias-Rodríguez, Oscar Iván Ávila-Montealegre, Oscar Reinaldo Becerra Camargo, Leonardo Bonilla-Mejía, Grey Yuliet Ceballos-García, Luz Adriana Flórez, Juan Miguel Gallego-Acevedo, Luis Armando Galvis-Aponte, Luis M. García-Pulgarín, Andrés Felipe García-Suaza, Anderson Grajales, Daniela Gualtero-Briceño, Didier Hermida-Giraldo, Ana María Iregui-Bohórquez, Juliana Jaramillo-Echeverri, Karen Laguna-Ballesteros, Francisco Javier Lasso-Valderrama, Daniel Márquez, Carlos Alberto Medina-Durango, Ligia Alba Melo-Becerra, María Fernanda Meneses-González, Juan José Ospina-Tejeiro, Andrea Sofía Otero-Cortés, Daniel Parra-Amado, Juana Piñeros-Ruiz, Christian Manuel Posso-Suárez, Natalia Ramírez-Bustamante, Mario Andrés Ramos-Veloz, Jorge Leonardo Rodríguez-Arenas, Alejandro Sarasti-Sierra, Bibiana Taboada-Arango, Ana María Tribín-Urbe, Juanita Villaveces

[El Sistema de Cuentas Nacionales por Sector Institucional: una mirada metodológica al caso colombiano](#)

Carlos David Ardila-Dueñas, Joel Santiago Castellanos-Caballero, Carlos David Murcia-Bustos

[Otras Publicaciones](#)

En este documento se utiliza el método de tendencias comunes (common trends) para estudiar los ciclos de las principales variables macroeconómicas colombianas durante el período 1950-2002. Una de las características más atractivas del método de tendencias comunes es que explota la relación de largo plazo que existe entre esas variables y que se deduce de un modelo completo con fundamentos microeconómicos. Se trata en este caso de un modelo de crecimiento neoclásico para una economía abierta el cual es utilizado para derivar los vectores de cointegración teóricos. Con base en estos últimos es posible construir los vectores autoregresivos restringidos que se emplean para examinar las fuentes de las

Tendencias estocásticas comunes y fluctuaciones en la economía colombiana: 1950-2002

## **Tendencias estocásticas comunes y fluctuaciones en la economía colombiana:**

**1950-2002. Portal de Investigaciones Económicas**

fluctuaciones macroeconómicas. En el trabajo se muestra como las restricciones de cointegración se utilizan para identificar un sistema VAR sujeto a cambios permanentes y transitorios en el crecimiento promedio y como dicho sistema responde a las innovaciones (shocks) a la tendencia.