

Un pronóstico no paramétrico de la inflación colombiana

Borradores de Economía

Número:

248

Publicado:

Domingo, 1 Junio 2003

Clasificación JEL:

C14, C22, C52, C53, E31

Palabras clave:

Non-parametric forecast, Kernel estimation, Forecast Evaluation, Bandwidth selection

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[Otras Publicaciones](#)

En este trabajo se presentan los resultados de un ejercicio de pronóstico no paramétrico múltiples pasos adelante para la inflación colombiana mensual. En particular, se usa estimación Kernel para la media condicional de los cambios de la inflación dada su propia historia. Los resultados de pronóstico se comparan con un modelo ARIMA estacional y un modelo tipo STAR. Se encuentra que, excepto para el pronóstico un mes adelante, el pronóstico no paramétrico mejora a las otras dos metodologías que le compiten; además, de entre las tres alternativas consideradas el no paramétrico es el único pronóstico que estadísticamente mejora al pronóstico que se hace con un modelo de caminata aleatoria. Palabras Claves: Pronóstico No Paramétrico. Evaluación y Comparación de Pronósticos. Ancho de Banda ("bandwidth"). Estimación Kernel. Pronóstico Rolling. SUMMARY This paper contains the results of a non parametric multi-step ahead forecast for the monthly Colombian inflation, using Mean conditional kernel estimation over inflation changes, with no inclusion of exogenous variables. The results are compared with those from an ARIMA and a non-linear STAR. The nonparametric forecast over perform the others two, as well as being the only, from the three, that statistically improved the naïve forecast given by a random-walk model.