

Combinación de brechas del producto colombiano

Borradores de Economía

Número:

775

Publicado:

Lunes, 1 Julio 2013

Clasificación JEL:

C32, C53, E37

Palabras clave:

Combinación de densidades de pronóstico, Brecha del producto, Pronósticos directos, Modelos VAR

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Otras Publicaciones](#)

Este documento combina estimaciones de ocho metodologías de la brecha del producto colombiano para el período comprendido entre el primer trimestre de 1994 y el tercer trimestre de 2012. A partir de modelos VAR que incluyen las diferentes brechas y la inflación se construyen las densidades combinadas de pronósticos de la brecha mediante el uso de tres esquemas de ponderación: logarítmicos, basados en puntuaciones de rango de probabilidad continuo (CRPS) y basados en el error cuadrático medio (MSE). Los resultados sugieren que las densidades combinadas bajo estos tres esquemas con horizontes de pronóstico de uno, dos, tres y cuatro trimestres adelante están bien especificadas. Adicionalmente, las puntuaciones logarítmicas calculadas sobre estas densidades muestran que las metodologías basadas en ponderadores logarítmicos para horizontes de pronóstico de dos y tres trimestres tienen significativamente un mejor desempeño que las calculadas por los ponderadores CRPS y MSE.