

Indicador mensual de actividad económica (IMAE) para el Valle del Cauca

Borradores de Economía

Número:

900

Publicado:

Sábado, 1 Agosto 2015

Clasificación JEL:

E32, E37, C43, C53

Palabras clave:

Indicador, Modelo factorial dinámico, Filtro de Kalman, Valle del Cauca

[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 el presente trabajo se lleva a un contexto regional la metodología de Stock y Watson (1991), usualmente aplicada en la construcción de indicadores de actividad económicas a nivel macroeconómico. A partir de siete series históricas claves del departamento del Valle del Cauca en Colombia, en el período 01 del 2000 a 03 de 2015, se construyó un indicador coincidente mensual de actividad económica (IMAE). Para ello se estimó, mediante el filtro de Kalman, un factor común a todas las variables empleando la metodología de los modelos factoriales dinámicos. El factor común estimado se ajustó a los datos anuales del crecimiento del PIB y luego se suavizó mediante un modelo estructural univariante de series temporales. Se obtiene así un indicador mensual que permite disponer de información en tiempo real sobre el estado de la economía del departamento, el cual sigue un patrón cíclico con una periodicidad promedio de cuatro años y 10 meses.