

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

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

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

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[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

[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.