

Cálculo del ranking acumulado para la encuesta de expectativas de inflación y tasa de cambio nominal, a través de una prueba no paramétrica

Borradores de Economía

Número:

688

Publicado:

Domingo, 1 Enero 2012

Palabras clave:

Encuesta de expectativas económicas, Prueba de hipótesis no paramétrica, Prueba de Jonckheere

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - 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

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

Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

En este documento se presenta una metodología para el cálculo del Ranking acumulado de las entidades financieras que participan en la encuesta mensual de expectativas de inflación y tasa de cambio nominal (TRM), realizada por el Banco de la República. La metodología se basa en la prueba estadística no paramétrica propuesta por Jonckheere (1954), que consiste en un sistema de hipótesis de igualdad de distribuciones de probabilidad acumulada con alternativa de ordenamiento estricto para k muestras ($k = 2$). La metodología busca determinar el orden óptimo con el cual se rechaza la hipótesis nula, esto último se hace por medio de permutaciones. Ésta metodología es implementada en el programa R.