

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

[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 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. Esta metodología es implementada en el programa R.