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 Economia
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

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
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.