Estimación de la variación del precio de los alimentos con modelos de frecuencias mixtas

Borradores de Economia
Número:
1109
DOI:
https://doi.org/10.32468/be.1109
Publicado:
Lunes, 30 Marzo 2020
Authors:
Julián Alonso Cárdenas-Cárdenas,
Edgar Caicedo-García,
Eliana Rocío González-Molano
Clasificación JEL:
C32, C51, C53, E31, E52
Palabras clave:
Inflacion de alimentos, nowcasting, modelos de frecuencias mixtas
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

Enfoque

Con el objetivo de capturar la alta volatilidad de los precios de los alimentos, los bancos centrales suelen construir modelos para pronosticar su desempeño en el corto plazo. Dichos modelos no suelen incorporar información de diferentes frecuencias (diario, semanal, mensual). Al incorporar esta información adicional de frecuencias mixtas, se quiere identificar si este tipo de modelos, desde el enfoque del nowcasting, mejoran el pronóstico de la variación de los precios de los alimentos.

Contribución

En este documento se desarrolla una metodología que aprovecha la información disponible con alta frecuencia (semanal) de precios y abastecimiento de alimentos, lo cual permite combinar información observada en varias frecuencias (MIDAS) para generar pronósticos alternativos de la variación mensual de los precios de los alimentos total y por componentes (perecederos y procesados) en el corto plazo, cuyo fin es mejorar los insumos incluidos en los modelos de simulación de la política monetaria, y así generar pronósticos de largo plazo de la inflación y otras variables relevantes.

> **Los resultados indican que los modelos propuestos de frecuencias mixtas, producen mejores pronósticos que los tradicionales que utilizan solamente información de precios del SIPSA (DANE)**

Resultados

Los resultados encontrados indican que los modelos propuestos de frecuencias mixtas, producen mejores estimaciones, en términos de menor error de pronóstico, para el mes en curso (nowcasting) de la variación mensual del grupo agregado de alimentos, perecederos y procesados, que aquellas estimaciones obtenidas a partir de información de precios del Sistema de Información de Precios del Sector Agropecuario (SIPSA-DANE). A medida que se cuenta con nueva información disponible (semanalmente) se pueden actualizar los pronósticos siendo estos más acertados.