Actualización de la descomposición del BEI cuando se dispone de nueva información

Borrador número 620 Tenga en cuenta
La serie Borradores de Economía, de la Subgerencia de Estudios Económicos del Banco de la República, contribuye a la difusión y promoción de la investigación realizada por los empleados de la institución. Esta serie se encuentra indexada en Research Papers in Economics (RePEc).

En múltiples ocasiones estos trabajos han sido el resultado de la colaboración con personas de otras instituciones nacionales o internacionales. Los trabajos son de carácter provisional, las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen al Banco de la República ni a su Junta Directiva.

Autores y/o editores Melo-Velandia, Luis Fernando Moreno, José Fernando

Este documento utiliza la metodología de Melo et al. (2003) para la actualización de la descomposición del Break Even Inflation (BEI) presentado en Melo y Granados (2010) cuando se dispone de nuevas observaciones. El procedimiento de actualización utiliza una transformación del modelo de estado espacio del BEI en el que se supone que los parámetros del modelo siguen una caminata aleatoria.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/actualizacion-descomposicion-del-bei-cuando-se-dispone-nueva-informacion