Revista Ensayos Sobre Política Económica (ESPE) - Desagregación de Series Temporales: Metodología y Aplicación al Caso del PIB en Colombia

Descargar Tenga en cuenta
En la revista Ensayos sobre Política Económica (ESPE) divulgamos los resultados y las propuestas de política que surgen de investigaciones académicas realizadas en el Banco de la República. Cuando nos lea, tenga siempre presente que el contenido de nuestros artículos, así como los análisis y conclusiones que de ellos se derivan, son exclusiva responsabilidad de sus autores. El material divulgado en nuestra revista ESPE no compromete ni representa la opinión del Banco de la República ni la de su Junta Directiva.

Autores y/o editores Melo-Velandia, Luis Fernando Misas-Arango, Martha Alicia Fecha de publicación Jueves, 31 de diciembre 1992
En este documento se presenta una metodología econométrica desarrollada por Guerrero (1990), que permite construir un estimador para reducir la periodicidad de series temporales. Bajo esta metodología, la estimación de la serie desagregada, es decir, de mayor frecuencia, se realiza replicando la dinámica capturada por la estructura de un modelo ARIMA de la serie indicadora considerando las restricciones impuestas por la serie agregada. Adicionalmente, una aplicación del método se lleva a cabo realizando una estimación trimestral del PIB anual colombiano para el período 1980-1991.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/publicaciones-investigaciones/espe/desagregacion-series-temporales-metodologia-y-aplicacion-caso-del-pib-colombia