Pronósticos de corto plazo en tiempo real para la actividad económica colombiana

Borrador número 724 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.

Autor o Editor Deicy Cristiano Manuel Hernández José David Pulido Autores y/o editores Cristiano-Botia, Deicy J. Pulido-Pescador, José David

La toma de decisiones de política económica requiere estimaciones del comportamiento de la actividad económica en tiempo real. Sin embargo, la información utilizada solo está disponible a nivel de indicadores de actividad y de encuestas de opinión, los cuales suelen tener distintas frecuencias y rezagos de publicación, además de choques idiosincráticos. En este trabajo se adaptan para la economía colombiana los esquemas de pronóstico de Camacho y Perez-Quiros (2009,2010) que producen estimaciones del crecimiento del PIB en tiempo real. El modelo de factores dinámicos adaptado involucra series de actividad de diferente frecuencia, disponibilidad y procedencia, empleadas con la información disponible en el momento de cada publicación. La evaluación de pronóstico sugiere que el modelo presenta un mejor desempeño frente a otros esquemas de referencia, y que la precisión de los pronósticos aumenta al incorporar el flujo de información en tiempo real de los indicadores de actividad.

Las opiniones expresadas en este documento son responsabilidad exclusiva de los autores y no comprometen ni al Banco de la República ni a su Junta Directiva. Así mismo los errores que pueda tener el documento son su responsabilidad exclusiva.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/borrador-724