Seminario 146 Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia

Seminario 146 Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia
Estadístico de la Universidad Nacional de Colombia, Master en Estadística de la University of Michigan, Especialista en Mercados de Capital y Especialista en Finanzas de la Universidad del Rosario. En la actualidad se desempeña como Econometrista Principal en la Unidad de Econometría de la Gerencia Técnica del Banco de la República, desde mayo de 2002. Su investigación se centra en temas de Econometría aplicada en macroeconomía y finanzas, Series de tiempo aplicada en macroeconomía y finanzas, y pronósticos de series macro y financieras.

Resumen

Este trabajo realiza una estimación de los efectos calendario sobre la industria manufacturera en Colombia para el período comprendido entre Enero de 1990 y Febrero de 2014. Para ello, se implementaron las metodologías de TRAMO-SEATS de Gómez y Maravall [1994, 1996] y TBATS de De~Livera et al. [2011]. Los resultados muestran que los efectos calendario sobre la industria son significativos, siendo el más relevante la semana santa. Aunque en ambos métodos los coeficientes asociados a dichos efectos impactan negativamente la producción industrial, en TRAMO-SEATS la magnitud de ellos es mayor que la estimada por TBATS. Se encuentra que la diferencia entre las tasas de crecimiento anual de los métodos cuando se modelan los efectos calendario respecto a la serie original son, en promedio, 1,36% para el primero y 2,82% para el segundo. Por último, la semana santa tiene un impacto promedio de 5,13% y 4,60%, respectivamente.

Inscripciones: inscríbase sin costo, enviando un correo a cospicar@banrep.gov.co o comunicándose al teléfono en Medellín 576 7463 ext. 4463
Hora: 12:15 p.m. (refrigerio) y 12:30 p.m. (inicio del seminario)
Lugar: Medellín, Auditorio del Banco de la República, Calle 50 No. 50-21, piso 3.

Documento del evento

Image not found or type unknown Efectos calendario sobre la producción industrial en Colombia

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/sse-medellin-146