La persistencia estadística de la inflación en Colombia

Borrador número 623 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 Juan José Echavarría Martha Misas Enrique López Autores y/o editores Echavarría-Soto, Juan José Misas-Arango, Martha Alicia López-Enciso, Enrique Antonio
En este documento se evalúan las diferentes formas de medición de la persistencia estadística y los distintos factores estructurales que podrían explicarla. Se presenta una medición de la persistencia estadística de la inflación y de la brecha de inflación en Colombia para el período 1990-2010, por medio de un modelo de cambio de régimen y de un filtro de Kalman. El régimen de inflación objetivo adoptado en 1999 permitió reducir la media y la varianza de la inflación pero no ha modificado la persistencia estadística de manera significativa.

La serie Borradores de Economía es una publicación de la Subgerencia de Estudios Económicos del Banco de la República. 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.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/persistencia-estadistica-inflacion-colombia