Metodologías semi-estructurales para estimar la Inflación básica mensual en Colombia

Borradores de Economía 1040 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 Norberto Rodríguez-Niño Alejandra Ramírez-Ramírez Autores y/o editores Alejandra Ramírez-Ramírez

Las opiniones contenidas en el presente documento son responsabilidad exclusiva de los autores y no comprometen al Banco de la República ni a su Junta Directiva.

Realizamos el cálculo de varias medidas (semi-)estructurales de inflación básica mensual de Colombia, para el periodo 2000:1-2017:11, a partir de dos metodologías semi-estructurales, a saber, modelos VAR estructurales (SVAR) y modelos macroeconómicos semiestructurales de tipo Neokeynesiano. Además, se realiza una evaluación de las medidas con base en siete criterios deseables para una medida de este tipo. Los resultados de evaluación individual favorecen la medida obtenida usando modelos Neokeynesianos semi-estructurales y luego la de un SVAR con restricción de signos; así mismo, auguran buen desempeño de promedios que incluyen cuatro medidas, entre ellas dos de las propuestas en este trabajo.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/borrador-1040