Cuantificación de encuestas ordinales y pruebas de racionalidad: una aplicación a la encuesta mensual de expectativas económicas

Borrador de Economía, núm. 649 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 Héctor Zárate Katherine Sánchez Margarita Marin Autores y/o editores Zárate-Solano, Héctor M. Katherine Sánchez Margarita Marin
En este artículo se cuantifican las respuestas cualitativas de la ?Encuesta Mensual de Expectativas Económicas (EEME)? a través de métodos de conversión tradicionales como la estadística del balance de Bachellier (1986), el método probabilístico propuesto por Carlson-Parkin (1975) y la propuesta de Análisis Cuantitativo Regional (ACR-2003). Para las respuestas analizadas de esta encuesta se encontró que el método ACR registra el mejor desempeño teniendo en cuenta su mejor capacidad predictiva. Esta cuantificación es posteriormente utilizada en pruebas de racionalidad de expectativas que requieren la verificación de cuatro hipótesis fundamentales: insesgamiento, correlación serial, eficiencia y ortogonalidad.

Fuente: https://d1b4gd4m8561gs.cloudfront.net/es/cuantificacion-encuestas-ordinales-y-pruebas-racionalidad-aplicacion-encuesta-mensual-expectativas