

CUADRO A4. Pruebas estadísticas del poder de predicción del indicador de expectativas de inflación del consumidor sobre la inflación anual de subíndices del INPC por objeto del gasto

<i>Subíndices del INPC por objeto del gasto vs indicador de expectativas de inflación</i>						<i>Intervalo de confianza al 95 por ciento</i>		
<i>Variable de cambio en la inflación</i>	<i>Método estadístico</i>	<i>Horizonte (meses)</i>	<i>Predicción (proporción éxitos/ABC)</i>	<i>Error estándar</i>	<i>Valor p</i>	<i>Límite inferior</i>	<i>Límite superior</i>	
<i>Salud y cuidado personal</i>								
Variable 1	Binomial	10	0.65	0.056	0.005	0.55	0.76	
	Pesaran y Timmerman	10	0.65	0.055	0.005	0.55	0.76	
	Curva ROC	10	0.65	0.061	0.017	0.53	0.77	
Variable 2	Binomial	3	0.61	0.053	0.033	0.51	0.72	
		10	0.63	0.056	0.020	0.52	0.73	
		11	0.61	0.056	0.044	0.51	0.72	
	N = 2	Pesaran y Timmerman	3	0.61	0.053	0.027	0.51	0.72
			10	0.63	0.055	0.015	0.52	0.74
			11	0.61	0.055	0.033	0.50	0.72
	Curva ROC	3	0.62	0.060	0.061	0.061	0.50	0.73
		10	0.63	0.062	0.040	0.040	0.51	0.76
		11	0.62	0.063	0.072	0.072	0.49	0.74
	Variable 2	Binomial	10	0.60	0.056	0.059	0.50	0.71
			11	0.64	0.056	0.014	0.53	0.74
			12	0.62	0.056	0.033	0.51	0.73
N = 3		Pesaran y Timmerman	10	0.60	0.055	0.047	0.50	0.71
			11	0.64	0.055	0.010	0.53	0.75
			12	0.62	0.055	0.023	0.51	0.73
Curva ROC		10	0.61	0.063	0.094	0.094	0.48	0.73
		11	0.64	0.062	0.029	0.029	0.52	0.76
		12	0.63	0.063	0.054	0.054	0.50	0.75
N = 4		Binomial	12	0.63	0.056	0.018	0.53	0.74
		Pesaran y Timmerman	12	0.63	0.056	0.015	0.52	0.74
		Curva ROC	12	0.63	0.063	0.039	0.51	0.76

*Alimentos, bebidas y tabaco*

Variable 1		Binomial	4	0.64	0.054	0.007	0.54	0.74
		Pesaran y Timmerman	4	0.64	0.053	0.006	0.54	0.75
		Curva ROC	4	0.65	0.060	0.019	0.53	0.76
Variable 2	N = 2	Binomial	4	0.61	0.054	0.042	0.51	0.71
		Pesaran y Timmerman	4	0.61	0.053	0.036	0.51	0.71
		Curva ROC	5	0.60	0.053	0.045	0.50	0.71
	N = 3	Binomial	4	0.61	0.061	0.073	0.49	0.73
		Pesaran y Timmerman	1 a 12	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50	
		Curva ROC	4	0.61	0.061	0.073	0.49	0.73
N = 4	Binomial	4	0.61	0.061	0.073	0.49	0.73	
	Pesaran y Timmerman	1 a 12	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50		
	Curva ROC	4	0.61	0.061	0.073	0.49	0.73	

*Ropa, calzado y accesorios*

Variable 1		Binomial	4	0.61	0.054	0.042	0.51	0.71
		Pesaran y Timmerman	12	0.65	0.056	0.010	0.54	0.75
		Curva ROC	4	0.61	0.053	0.042	0.51	0.71
	N = 2	Binomial	12	0.65	0.056	0.009	0.54	0.75
		Pesaran y Timmerman	4	0.61	0.061	0.083	0.49	0.73
		Curva ROC	12	0.65	0.063	0.024	0.53	0.77
Variable 2	N = 2	Binomial	6	0.61	0.054	0.039	0.51	0.72
		Pesaran y Timmerman	12	0.67	0.056	0.002	0.57	0.77
		Curva ROC	6	0.61	0.053	0.041	0.51	0.72
	N = 3	Binomial	12	0.67	0.055	0.002	0.56	0.78
		Pesaran y Timmerman	6	0.61	0.063	0.078	0.49	0.74
		Curva ROC	12	0.68	0.062	0.007	0.56	0.80
	N = 4	Binomial	6	0.61	0.054	0.039	0.51	0.72
		Pesaran y Timmerman	12	0.65	0.056	0.010	0.54	0.75
		Curva ROC	6	0.61	0.053	0.040	0.51	0.72
N = 4	Binomial	12	0.65	0.055	0.008	0.54	0.75	
	Pesaran y Timmerman	6	0.61	0.063	0.079	0.49	0.74	
	Curva ROC	12	0.65	0.063	0.022	0.53	0.78	
N = 4	Binomial	12	0.68	0.056	0.001	0.58	0.79	
	Pesaran y Timmerman	12	0.68	0.055	0.001	0.58	0.79	
	Curva ROC	12	0.70	0.061	0.003	0.58	0.82	

CUADRO A4 (continuación)

<i>Subíndices del INPC por objeto del gasto vs indicador de expectativas de inflación</i>						<i>Intervalo de confianza al 95 por ciento</i>		
<i>Variable de cambio en la inflación</i>	<i>Método estadístico</i>	<i>Método estadístico</i>	<i>Predicción (proporción éxitos/ABC)</i>	<i>Error estándar</i>	<i>Valor p</i>	<i>Límite inferior</i>	<i>Límite superior</i>	
<i>Transporte</i>								
Variable 1	Binomial							
	Pesaran y Timmerman	1 a 12	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50		
	Curva ROC							
Variable 2		3	0.64	0.053	0.011	0.54	0.74	
		6	0.39	0.054	0.039	0.28	0.49	
		10	0.36	0.056	0.011	0.25	0.46	
	N = 2		3	0.64	0.053	0.009	0.53	0.74
		Pesaran y Timmerman	6	0.39	0.054	0.040	0.28	0.49
			10	0.36	0.055	0.011	0.25	0.47
		3	0.64	0.060	0.023	0.53	0.76	
		6	0.61	0.062	0.080	0.49	0.73	
		10	0.64	0.063	0.031	0.52	0.76	
	N = 3	Binomial	10	0.36	0.056	0.011	0.25	0.46
		Pesaran y Timmerman	10	0.36	0.055	0.011	0.25	0.47
		Curva ROC	10	0.64	0.062	0.030	0.52	0.76
N = 4	Binomial	10	0.37	0.056	0.020	0.27	0.48	
	Pesaran y Timmerman	10	0.37	0.055	0.020	0.26	0.48	
	Curva ROC	10	0.63	0.063	0.047	0.51	0.75	
<i>Muebles, aparatos y accesorios domésticos</i>								
Variable 1	Binomial	7	0.64	0.055	0.009	0.54	0.75	
	Pesaran y Timmerman	7	0.64	0.053	0.009	0.54	0.75	
	Curva ROC	7	0.64	0.061	0.026	0.52	0.76	

Variable 2	<i>N</i> = 2	Binomial	6	0.62	0.054	0.023	0.52	0.73	
			7	0.61	0.055	0.050	0.50	0.71	
			8	0.63	0.055	0.021	0.52	0.73	
		Pesaran y Timmerman	6	0.62	0.053	0.023	0.52	0.73	
			7	0.61	0.053	0.054	0.50	0.71	
			8	0.63	0.054	0.021	0.52	0.73	
		Curva ROC	6	0.62	0.062	0.052	0.50	0.74	
			7	0.61	0.062	0.097	0.48	0.73	
			8	0.63	0.062	0.049	0.50	0.75	
	<i>N</i> = 3	Binomial	6	0.62	0.054	0.023	0.52	0.73	
			8	0.63	0.055	0.021	0.52	0.73	
			6	0.62	0.053	0.023	0.52	0.73	
		Pesaran y Timmerman	8	0.63	0.054	0.021	0.52	0.73	
			6	0.62	0.062	0.052	0.50	0.74	
			8	0.63	0.062	0.049	0.50	0.75	
		<i>N</i> = 4	Binomial	6	0.62	0.054	0.023	0.52	0.73
				7	0.63	0.055	0.016	0.53	0.73
				8	0.65	0.055	0.006	0.55	0.75
	9			0.62	0.055	0.027	0.52	0.73	
	6			0.62	0.053	0.023	0.52	0.73	
	7			0.63	0.053	0.017	0.53	0.74	
	Pesaran y Timmerman		8	0.65	0.054	0.006	0.55	0.76	
			9	0.62	0.054	0.026	0.52	0.73	
			6	0.62	0.062	0.052	0.50	0.74	
Curva ROC	7	0.63	0.062	0.042	0.51	0.75			
	8	0.65	0.061	0.019	0.53	0.77			
	9	0.62	0.063	0.059	0.50	0.74			

CUADRO A4 (continuación)

<i>Subíndices del INPC por objeto del gasto vs indicador de expectativas de inflación</i>						<i>Intervalo de confianza al 95 por ciento</i>		
<i>Variable de cambio en la inflación</i>	<i>Método estadístico</i>	<i>Horizonte (meses)</i>	<i>Predicción (proporción éxitos/ABC)</i>	<i>Error estándar</i>	<i>Valor p</i>	<i>Límite inferior</i>	<i>Límite superior</i>	
<i>Educación y esparcimiento</i>								
Variable 1	Binomial	2	0.63	0.053	0.015	0.53	0.73	
		5	0.63	0.054	0.018	0.53	0.73	
	Pesaran y Timmerman	2	0.63	0.053	0.014	0.53	0.73	
		5	0.63	0.054	0.017	0.52	0.73	
	Curva ROC	2	0.63	0.059	0.035	0.51	0.75	
		5	0.63	0.061	0.039	0.51	0.75	
Variable 2	N = 2	Binomial	3	0.63	0.053	0.019	0.52	0.73
		Pesaran y Timmerman	3	0.63	0.052	0.020	0.52	0.73
		Curva ROC	3	0.63	0.061	0.047	0.51	0.75
Variable 2	N = 3	Binomial	3	0.64	0.053	0.011	0.54	0.74
		Pesaran y Timmerman	3	0.64	0.052	0.011	0.53	0.74
		Curva ROC	3	0.64	0.061	0.030	0.52	0.76
Variable 2	Binomial	2	0.65	0.053	0.004	0.55	0.75	
		3	0.63	0.053	0.019	0.52	0.73	
	N = 4	Pesaran y Timmerman	2	0.65	0.051	0.004	0.55	0.75
			3	0.63	0.052	0.020	0.52	0.73
	Curva ROC	2	0.66	0.060	0.014	0.54	0.77	
		3	0.63	0.062	0.046	0.51	0.75	

*Otros servicios*

Variable 1	Binomial	2	0.64	0.053	0.008	0.54	0.74	
	Pesaran y Timmerman	2	0.64	0.053	0.008	0.54	0.74	
	Curva ROC	2	0.64	0.059	0.023	0.52	0.76	
Variable 2		1	0.67	0.053	0.002	0.57	0.76	
	Binomial	2	0.66	0.053	0.002	0.56	0.76	
		3	0.70	0.053	0.000	0.61	0.80	
		1	0.67	0.052	0.001	0.56	0.77	
	N = 2	Pesaran y Timmerman	2	0.66	0.053	0.002	0.56	0.77
			3	0.70	0.053	0.000	0.60	0.81
			1	0.67	0.058	0.006	0.55	0.78
	Curva ROC	2	0.66	0.058	0.008	0.55	0.78	
		3	0.70	0.056	0.001	0.59	0.82	
		1	0.64	0.053	0.006	0.55	0.74	
	Variable 2	Binomial	2	0.62	0.053	0.026	0.52	0.72
			3	0.66	0.053	0.003	0.56	0.76
			4	0.61	0.054	0.042	0.51	0.71
			1	0.64	0.052	0.006	0.54	0.75
		N = 3	Pesaran y Timmerman	2	0.62	0.053	0.025	0.51
3				0.66	0.053	0.003	0.56	0.76
4				0.61	0.053	0.041	0.50	0.71
1				0.64	0.059	0.018	0.53	0.76
Curva ROC		2	0.62	0.060	0.056	0.50	0.74	
		3	0.66	0.059	0.010	0.54	0.77	
		4	0.61	0.061	0.082	0.49	0.73	

CUADRO A4 (conclusión)

<i>Subíndices del INPC por objeto del gasto vs indicador de expectativas de inflación</i>						<i>Intervalo de confianza al 95 por ciento</i>	
<i>Variable de cambio en la inflación</i>	<i>Método estadístico</i>	<i>Horizonte (meses)</i>	<i>Predicción (proporción éxitos/ABC)</i>	<i>Error estándar</i>	<i>Valor p</i>	<i>Límite inferior</i>	<i>Límite superior</i>
<i>Otros servicios</i>							
<i>N = 4</i>	<i>Binomial</i>	1	0.66	0.053	0.003	0.56	0.75
		2	0.63	0.053	0.015	0.53	0.73
		3	0.67	0.053	0.001	0.57	0.77
		4	0.64	0.054	0.007	0.54	0.74
	<i>Pesaran y Timmerman</i>	1	0.66	0.052	0.003	0.55	0.76
		2	0.63	0.053	0.014	0.53	0.73
		3	0.67	0.053	0.001	0.57	0.77
		4	0.64	0.053	0.007	0.54	0.75
	<i>Curva ROC</i>	1	0.66	0.058	0.011	0.54	0.77
		2	0.63	0.059	0.036	0.51	0.75
		3	0.67	0.058	0.006	0.56	0.78
		4	0.64	0.060	0.022	0.53	0.76
<i>Vivienda</i>							
<i>Variable 1</i>	<i>Binomial</i>	<i>1 a 12</i>	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50	
	<i>Pesaran y Timmerman</i>						
	<i>Curva ROC</i>						
<i>N = 2</i>	<i>Binomial</i>	<i>1 a 12</i>	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50	
	<i>Pesaran y Timmerman</i>						
	<i>Curva ROC</i>						
<i>Variable 2</i>	<i>Binomial</i>	<i>1 a 12</i>	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50	
	<i>Pesaran y Timmerman</i>						
	<i>Curva ROC</i>						
<i>N = 4</i>	<i>Binomial</i>	<i>1 a 12</i>	0.50	—	>0.05	Contiene a 0.50	
	<i>Pesaran y Timmerman</i>						
	<i>Curva ROC</i>						