

Uso de Modelos Macroeconómicos en el Banco Central de Chile, 2020

Anexo online

Última actualización: Diciembre, 2022

Como complemento al documento principal sobre el uso de modelos macroeconómicos en el BCCh, se provee documentación anexa con el objeto de entregar mayor detalle técnico en cuanto a los principales modelos descritos. Adicionalmente, se proveen los códigos de los principales modelos de equilibrio general, el MSEP y el XMAS. A continuación, se resume el material incluido que complementa lo descrito en las correspondientes secciones del libro:

- Sección 3.1: **Modelos para sector externo**
 - Beltrán F., Calvo G., Correa G., Opazo T., Riquelme V., Rodríguez D. y Wlasiuk JM. (2020). Modelos estructurales y de forma reducida para la economía internacional. Mimeo. Banco Central de Chile.
- Sección 3.2: **Modelos econométricos para la economía doméstica**
 - 3.2.1: **Proyecciones del sector real**
 - Cobb, M., y Peña, J. (2020). Proyecciones de Corto Plazo para el PIB Trimestral: Desempeño Reciente de una Serie de Modelos Estándar. Documento de Trabajo No. 871, Banco Central de Chile.
 - 3.2.2: **Proyecciones de inflación.**
 - Carlomagno, G. y Torres, J. (2020), Uso de modelos econométricos para la proyección de inflación en el Banco Central de Chile.
 - Carlomagno, G. y Sansone, A. (2019). Marco Metodológico para la Construcción de Indicadores de Inflación Subyacente. Mimeo, Banco Central de Chile.
- Sección 3.3: **Modelos estructurales para la economía doméstica**
 - 3.3.1: **MSEP: Modelo semi-estructural de proyecciones**
 - Arroyo F., Bullano F., Fornero J., Zúñiga R. (2020). Semi-Structural Forecasting Model. Documento de Trabajo No. 866, Banco Central de Chile.
 - Incluye códigos para replicar principales resultados del trabajo.
 - 3.3.2: **XMAS: Modelo extendido para análisis y simulaciones**
 - García, B., Guarda, S., Kirchner, M., y Tranamil, R. (2019). XMAS: An Extended Model for Analysis and Simulations. Documento de Trabajo No. 833, Banco Central de Chile.
 - Incluye códigos para replicar principales resultados del trabajo.
 - García, B., y Guerra-Salas J. (2020). On the Response of Inflation and Monetary Policy to an Immigration Shock. Documento de Trabajo No. 872, Banco Central de Chile.
 - Incluye códigos para replicar principales resultados del trabajo.

- Sección 3.4: **Estimación de inobservables**
 - Aldunate, R., F. Bullano, M. Canales, G. Contreras, A. Fernández, J. Fornero, M. García, G. García, J. Peña, M. Tapia y R. Zúñiga (2019). Estimación de Parámetros Estructurales de la Economía Chilena. Mimeo, Banco Central de Chile.
 - 3.4.1: **Crecimiento del PIB: tendencial y potencial**
 - Banco Central de Chile (2017a). Crecimiento tendencial: proyección de mediano plazo y análisis de sus determinantes.
- Sección 4.1: **Modelos satélite de uso complementario/Modelos econométricos**
 - Sección 4.1.2: **Proyecciones para el escenario fiscal**
 - Fornero J., Guerra-Salas J. y Pérez-Núñez C. (2019). Multiplicadores Fiscales en Chile. Revista Economía Chilena.
 - Sección 4.1.3: **Modelos para análisis de alta frecuencia del tipo de cambio nominal**
 - Cowan, K. Rappoport, D. y Selaive J (2007). High Frequency Dynamics of the Exchange Rate in Chile. Documento de Trabajo No. 433, Banco Central de Chile.
 - Sección 4.1.4: **Modelos VAR para análisis del traspaso de tipo de cambio a inflación**
 - Contreras, G. y F. Pinto (2016). Traspaso de Tipo de Cambio Nominal a Inflación Desagregada en Chile. Economía Chilena.
 - Justel, S., y Sansone A. (2016). Exchange Rate Pass-Through to Prices: VAR Evidence for Chile. Economía chilena.
- Sección 4.2: **Modelos satélite de uso complementario/Modelos estructurales**
 - Sección 4.2.1: **Aprendizaje, expectativas y desanclaje**
 - Arias, A., & Kirchner, M. (2019). Shifting Inflation Expectations and Monetary Policy. Documento de Trabajo No. 829. Banco Central de Chile.
 - Sección 4.2.2: **Traspaso condicional del tipo de cambio en un modelo con transables y no transables**
 - García, M. y García-Cicco, J. (2020). A TNT DSGE Model for Chile: Explaining the ERPT. Documento de Trabajo No. 868, Banco Central de Chile.
 - Sección 4.2.3: **Generaciones traslapadas y análisis de largo plazo**
 - Arias, A., y Guerra-Salas, J. (2019). Immigration in Emerging Countries: A Macroeconomic Perspective. Documento de Trabajo No. 857, Banco Central de Chile.
 - Banco Central de Chile (2017b). Evaluación de impactos macroeconómicos de largo plazo de modificaciones al sistema de pensiones.
 - Incluye códigos para replicar principales resultados del trabajo.