

Transmisión de precios en el sector de la palta en Chile: Evidencia desde un modelo VAR cointegrado

IX Encuentro de la Sociedad Chilena de Estudios Regionales

Héctor Garrido Henríquez

28 de septiembre de 2017

Los datos

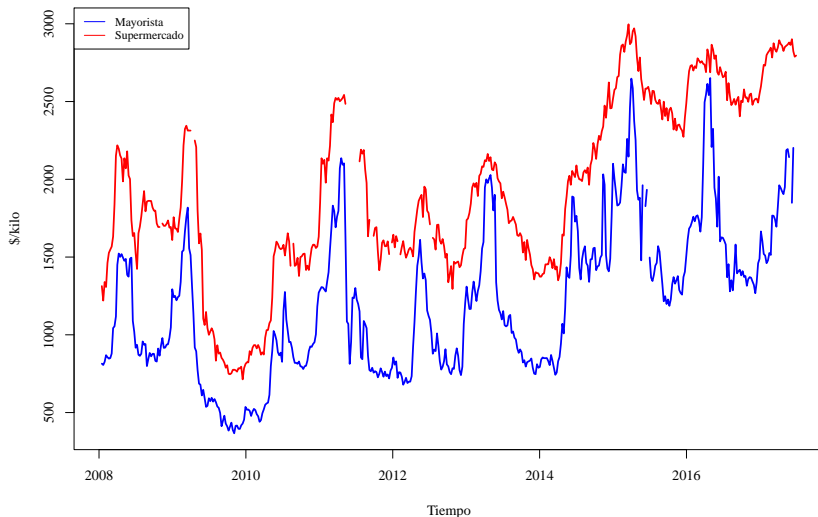


Figure 1: Evolución de Precios semanales para la palta de larga vida de primera calidad

Imputación de datos perdidos

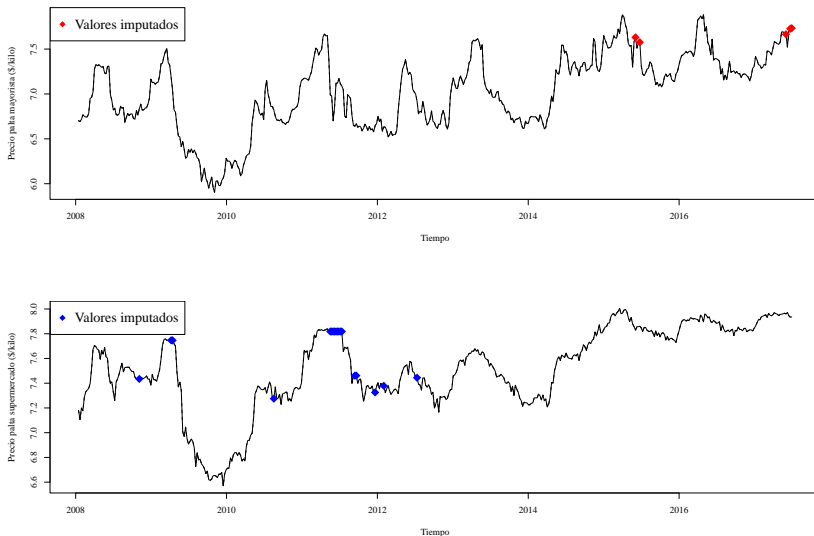
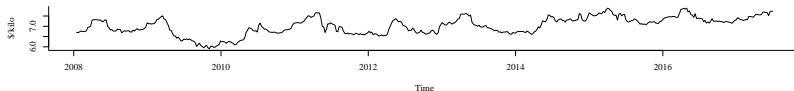


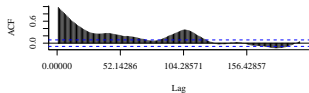
Figure 2: Imputación de datos perdidos mediante el filtro de Kalman

Estacionariedad de las series

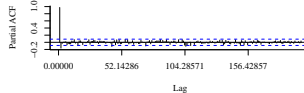
a) Evolución log(precios) mayoristas, 2008–2017



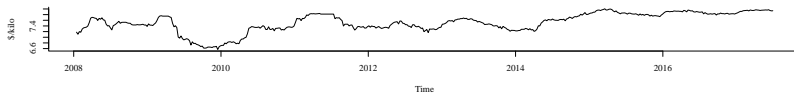
b) Función de autocorrelación log(precios) mayoristas



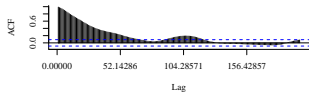
c) Función de autocorrelación parcial log(precios) mayoristas



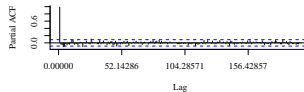
d) Evolución log(precios) supermercado, 2008–2017



e) Función de autocorrelación log(precios) supermercado



f) Función de autocorrelación parcial log(precios) supermercado



Contrastes de raíz unitaria - Dickey-Fuller Aumentado

	Estadístico		Valores críticos		
\mathcal{H}_0	Mayorista ^a	Supermercado ^b	90 %	95 %	99 %
τ_2	-2.5725	-1.6393	-2.57	-2.87	-3.44
ϕ_1	3.4095	1.6354	3.79	4.61	6.47

a: con drift y un rezago de acuerdo a criterio BIC

	Estadístico		Valores críticos		
\mathcal{H}_0	Mayorista ^a	Supermercado ^b	90 %	95 %	99 %
τ_3	-3.4073	-2.1143	-3.13	-3.42	-3.98
ϕ_2	3.9655	1.6848	4.05	4.71	6.15
ϕ_3	5.84	2.2351	5.36	6.30	8.34

b: con drift, tendencia determinista y un rezago de acuerdo a criterio BIC

Contrastes de raíz unitaria - Phillips-Perron

	$Z(t_{\hat{\alpha}})$	$Z(t_{\hat{\mu}})$
Mayorista	-13.3185	2.5034
Supermercado	-6.8785	1.846

a: con drift

	$Z(t_{\hat{\alpha}})$	$Z(t_{\hat{\mu}})$	$Z(t_{\hat{\beta}})$
Mayorista	-22.1367	1.5224	2.2482
Supermercado	-11.958	1.0702	1.6795

b: con drift y tendencia determinista

con cinco rezagos de acuerdo a la regla $\mathbf{lags} = \sqrt[4]{4 \times (n/100)}$

Contrastes de raíz unitaria - Elliot, Rothenberg & Stock

Estadístico		Valores críticos		
Mayorista ^a	Supermercado ^b	90 %	95 %	99 %
-3.1558	-2.0504	-2.57	-2.89	-3.48

a: con drift y un rezago de acuerdo a criterio BIC

Estadístico		Valores críticos		
Mayorista ^a	Supermercado ^b	90 %	95 %	99 %
-2.3519	-0.8837	-1.62	-1.94	-2.57

b: con drift, tendencia determinista y un rezago de acuerdo a criterio BIC

Contrastes de raíz unitaria/estacionariedad - Kiatkowsky,Phillips, Schimdt & Shin (KPSS)