



PRECIOS A PRODUCTOR DE VINOS A GRANEL EN CHILE: ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO

**JOSÉ MARCELO ADASME VALENZUELA
JUANY DANIELA MORAGA QUINTEROS
INGENIERO COMERCIAL MENCIÓN INFORMATICA**

El presente estudio tiene como objetivo predecir el precio de vinos a granel correspondiente a las cepas Cabernet, Semillón, País y Burdeos, para el año 2009. Se trabajó con series históricas de precios nominales sacadas de ODEPA durante el periodo 2003-2008, obteniendo en total sesenta datos.

Para efectuar el pronóstico se trabajó con las series de precios aplicando diversos test de contrastes de estacionariedad como Dickey Fuller y Phillips Perron. Además de un análisis de quiebres estructurales para poder determinar posibles quiebres significativos o tendencias de las series de precios.

Obtenidas ya las series de precios óptimas para el modelo, se procedió a realizar el pronóstico de precios para el año 2009. Además se determinó cual es la volatilidad implícita que afecta a los precios de los vinos a granel de estas cuatro cepas en estudio.

Se trabajó con series de precios nominales, los cuales se actualizarán mediante el Índice de Precios Mayoristas (IPM), para de ésta manera trabajar con una serie de precios reales. Posteriormente se determinó la estacionariedad de la serie utilizando los test anteriormente mencionados.

Una vez confirmada la estacionariedad de la serie se procede a realizar el análisis de los posibles quiebres estructurales el cual se determinó con un nivel de confianza del 95%, dejando un 5% de error.

El fin de este estudio es poder dar una herramienta de apoyo para los productores de vinos a granel, tanto de las cepas en estudio como para la industria, así con esto poder gestionar el riesgo de manera óptima para la toma de decisiones.