

Forecasting Latin-American Yield Curves: An Artificial Neural Network Approach

Número:

761

Publicado:

Viernes, 1 Marzo 2013

Clasificación JEL:

C32, C45, E43, G17

Palabras clave:

Term structure of interest rates, Nelson & Siegel, Svensson, out-of-sample forecast

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Borradores de Economía - ¿Los desastres naturales y los anuncios de eventos ENSO tienen un impacto en las medidas de expectativas de inflación basadas en el mercado?](#)

Luis Fernando Melo-Velandia, Daniel Parra-Amado, Juan Pablo Bermúdez-Cespedes

[Riesgo de balance en los bancos centrales: el papel del capital y las estrategias para preservarlo](#)

Lina Fernanda Torres-Gutierrez, Gonzalo Ossa-Stipcianos, Edwin Mauricio Parra-Rodriguez, Egberto Alexander Riveros, Alvaro José Martinez-Monroy, Julián Andrés Gomez-Duran, Juan Sebastián Rojas-Moreno

[De la calamidad a la oportunidad: mejoras en la calidad habitacional en Colombia durante el Fenómeno de la Niña 2010 - 2011](#)

Andrés Mauricio Sánchez-Jabba

[Otras Publicaciones](#)

This document explores the predictive power of the yield curves in Latin America (Colombia, Mexico, Peru and Chile) taking into account the factors set by the specifications of Nelson y Siegel and Svensson. Several forecasting methodologies are contrasted