

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

Borradores de Economía

**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

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[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