

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

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[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