

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

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[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