

Evaluación de pronóstico de una red neuronal sobre el PIB en Colombia

Borradores de Economía

Número:

575

Publicado:

Jueves, 1 Octubre 2009

Clasificación JEL:

C45, C53, E17, E23

Palabras clave:

Red neuronal artificial, No linealidad, PIB, Rolling de pronóstico

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - 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

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

Las redes neuronales artificiales han mostrado ser modelos robustos para dar cuenta del comportamiento de diferentes variables. En el presente trabajo se emplean para modelar la relación no lineal del crecimiento del PIB. Tres modelos son considerados: dos autoregresivos (especificación lineal y no lineal) y una red neuronal que usa la tasa de interés. Evaluando el desempeño de los modelos dentro y fuera de muestra, los pronósticos realizados por las redes neuronales artificiales superan ampliamente a los modelos lineales, siendo esta evidencia de relaciones asimétricas en el comportamiento del PIB en Colombia.