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

Borradores de Economia
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

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
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.