Evaluación asimétrica de una red neuronal artificial: Aplicación al caso de la inflación en Colombia

Borradores de Economia
Número:
377
Publicado:
Miércoles, 1 Febrero 2006
Clasificación JEL:
C45, E31
Palabras clave:
Red neuronal artificial, No linealidad, Unidad escondida, Función de activación
Descargar documento

Lo más reciente

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
Otras Publicaciones

El objetivo de este trabajo es explorar la relación no lineal entre el dinero y la inflación en Colombia a través de una red neuronal artificial (RNA), utilizando información mensual de la variación del IPC y del agregado monetario M3, desde 01 de 1982 hasta 02 de 2005. La Constitución de 1991 le otorgo al Banco de la República la responsabilidad de velar por la estabilidad de precios. Este hecho, sumado al rezago con el que las políticas monetarias afectan a su variable objetivo, en este caso la inflación, hace indispensable para las autoridades monetarias, contar con los mejores modelos para pronosticarla y guiar sus decisiones de política. Las RNA aparecen como una excelente alternativa para lograr este propósito, dado el comportamiento intrínsecamente no lineal exhibido por la relación entre estas variables. El presente trabajo incorpora algunas innovaciones en la modelación de dinero e inflación, que permiten generar pronósticos más confiables, debido a que el modelo se aproxima con 05r exactitud a la realidad. Tales innovaciones se refieren a una selección mas sofisticada de los rezagos significativos que deben ser incorporados en el modelo, una construcción de pronósticos que actualiza su base de datos y una función de costos asimétricos para su evaluación.
