

Evaluación asimétrica de una red

neuronal artificial: Aplicación al caso de la inflación en Colombia

Borradores de Economía

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

[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](#)

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.