La demanda de efectivo en Colombia: una caja negra a la luz de las redes neuronales

Borradores de Economia
Número:
268
Publicado:
Lunes, 1 Diciembre 2003
Clasificación JEL:
E41, E47, C45
Palabras clave:
Demanda de dinero, No linealidades, redes neuronales
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

En el caso colombiano la tarea de pronosticar el futuro comportamiento se ha convertido en un verdader reto ya que durante la última década la economía ha sufrido importantes transformaciones que han del impuesto a las transacciones financieras. Al mismo tiempo, los ciclos de la actividad económica parecen ser más pronunciados. Estos cambios cobran especial relevancia en la medida en que la demanda de dinero esté asociada en forma no lineal con sus determinantes. En este trabajo se explora esta posible relación no lineal y se explota la flexibilidad de las redes neuronales artificiales -ANN- para modelarla. Las ganancias en los errores de pronóstico y la significancia estadística de las pruebas de no linealidad frente a modelos de naturaleza lineal auguran un futuro promisorio a estas técnicas que permiten predecir mejor el futuro en un entorno cambiante.