

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

Borradores de Economía

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

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

En el caso colombiano la tarea de pronosticar el futuro comportamiento se ha convertido en un verdadero 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.