

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

[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](#)

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.