

Evaluación de pronósticos del tipo de cambio utilizando redes neuronales y funciones de pérdida asimétricas - Portal de Investigaciones Económicas

Evaluación de pronósticos del tipo de cambio utilizando redes neuronales y funciones de pérdida asimétricas

Borradores de Economía

Número:

376

Publicado:

Miércoles, 1 Febrero 2006

Clasificación JEL:

C22, C53, F31

Palabras clave:

Tipo de cambio, Redes neuronales artificiales, Evaluación de pronóstico.

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[El Sistema de Cuentas Nacionales por Sector Institucional: una mirada metodológica al caso colombiano](#)

Carlos David Ardila-Dueñas, Joel Santiago Castellanos-Caballero, Carlos David Murcia-Bustos
[Una década de cambios en la pobreza monetaria en Colombia: respuestas locales a choques agregados](#)

Karina Acosta, Jesus Saldaña

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los desastres naturales en la Vía Panamericana sobre el movimiento de carga](#)

Jhorland Ayala-García, Leider Manjarres-Beleño, María Urueta-Polo

[Otras Publicaciones](#)

El presente trabajo compara especificaciones lineales y no lineales (expresadas en redes neuronales artificiales) ajustadas a la variación porcentual diaria del tipo de cambio utilizando para ello funciones de costo tradicionales (simétricas) a la vez que se introduce el análisis asimétrico. Los resultados muestran que las redes neuronales permiten obtener mejores pronósticos con ambos tipos de funciones de costos. Sin embargo, es de anotar que cuando se evalúan los pronósticos con funciones asimétricas, el modelo no lineal supera ampliamente a su contraparte lineal.