

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

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[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.