Revista Ensayos Sobre Política Económica (ESPE) – No-linealidades en la demanda de efectivo en Colombia: las redes neuronales como herramienta de pronóstico

Descargar Tenga en cuenta
En la revista Ensayos sobre Política Económica (ESPE) divulgamos los resultados y las propuestas de política que surgen de investigaciones académicas realizadas en el Banco de la República. Cuando nos lea, tenga siempre presente que el contenido de nuestros artículos, así como los análisis y conclusiones que de ellos se derivan, son exclusiva responsabilidad de sus autores. El material divulgado en nuestra revista ESPE no compromete ni representa la opinión del Banco de la República ni la de su Junta Directiva.

Autores y/o editores Misas-Arango, Martha Alicia López-Enciso, Enrique Antonio Arango-Arango, Carlos Alberto Hernández-Aguilera, Juan Nicolás Fecha de publicación Miércoles, 30 de junio 2004
En Colombia, como en muchos países que han optado por un régimen de inflación objetivo, se continúa monitoreando el comportamiento de algunas variables monetarias, dentro de ellas el efectivo, y pronosticando su senda futura, utilizando para ello modelos econométricos de diversas clases. Sin embargo, la historia reciente del efectivo ha mostrado que se trata de una variable muy difícil de modelar mediante especificaciones lineales. De otro lado, no son satisfactorios los resultados obtenidos con modelos univariados de series de tiempo (ARIMA y ARIMA con intervención y transferencia) en la medida en que se han presentado elevados errores de pronóstico.

Fuente: https://d1b4gd4m8561gs.cloudfront.net/es/publicaciones-investigaciones/espe/no-linealidades-demanda-efectivo-colombia