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

Descargar Tenga en cuenta
La serie Borradores de Economía, de la Subgerencia de Estudios Económicos del Banco de la República, contribuye a la difusión y promoción de la investigación realizada por los empleados de la institución. Esta serie se encuentra indexada en Research Papers in Economics (RePEc).

En múltiples ocasiones estos trabajos han sido el resultado de la colaboración con personas de otras instituciones nacionales o internacionales. Los trabajos son de carácter provisional, las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen al Banco de la República ni a su Junta Directiva.

Autores y/o editores Misas-Arango, Martha Alicia Arango-Arango, Carlos Alberto López-Enciso, Enrique Antonio Hernández-Aguilera, Juan Nicolás Fecha de publicación Lunes, 8 de diciembre 2003
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.

Fuente: https://d1b4gd4m8561gs.cloudfront.net/es/publicaciones-investigaciones/borradores-economia/demanda-efectivo-colombia-caja-negra