Evaluación de pronóstico de una red neuronal sobre el PIB en Colombia

Borrador número 575 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.

Autor o Editor José Mauricio Salazar Sáenz Autores y/o editores José Mauricio Salazar Sáenz
Las redes neuronales artificiales han mostrado ser modelos robustos para dar cuenta del comportamiento de diferentes variables. En el presente trabajo se emplean para modelar la relación no lineal del crecimiento del PIB. Tres modelos son considerados: dos autoregresivos (especificación lineal y no lineal) y una red neuronal que usa la tasa de interés. Evaluando el desempeño de los modelos dentro y fuera de muestra, los pronósticos realizados por las redes neuronales artificiales superan ampliamente a los modelos lineales, siendo esta evidencia de relaciones asimétricas en el comportamiento del PIB en Colombia.
La serie Borradores de Economía es una publicación de la Subgerencia de Estudios Económicos del Banco de la República. 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.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/evaluacion-pronostico-red-neuronal-sobre-el-pib-colombia