Seminario 531. Pronosticando el precio de la energía eléctrica en Colombia. Una comparación entre modelos ARMA y Redes neuronales

Calendario de actividades

- Director Departamento de Economía, Universidad de Antioquia

Co-autores: Elkin Tabares y Esteban Velilla (Universidad de Antioquia)

Entrada libre. Indispensable inscribirse en el siguiente vínculo: Inscripciones

Si no pudo inscribirse por medio de nuestra herramienta, separe su cupo enviando sus datos completos a dcef-portales@banrep.gov.co, e indique en el asunto del correo el nombre completo del seminario al cual desea inscribirse.

Hora: 12:00 *p. m.* (refrigerio) y 12:30 *p. m.* (inicio del seminario)
Tiempo de exposición: 12:30 *p. m.* a 1:30 *p. m.*
Lugar: Banco de la República, carrera 7 # 14-78, piso 13 (Sala de prensa), Bogotá-Colombia.
Idioma de la exposición: Español

Resumen del documento: El objetivo de este estudio es pronosticar los precios de la electricidad en el mercado eléctrico colombiano. Para lograrlo se han implementado modelos autoregresivos de media móvil (ARMAX) y redes neuronales autorregresivas no lineales (NARX), en ambos casos con entradas exógenas. Los resultados muestran que el desempeño del NARX no es necesariamente significativamente mejor que el de ARMAX. Después, se aplica un test de Diebold-Mariano para determinar la precisión del pronóstico, del cual se concluye que no es posible rechazar la hipótesis nula. Finalmente, se pone a prueba la capacidad de los modelos para predecir comparando los pronósticos con los precios observados en bolsa en un horizonte de 12 meses.

Pronosticando el precio de la energía eléctrica en Colombia. Una comparación entre modelos ARMA y Redes neuronales

Si desea inscribirse a la lista de correos del Seminario semanal de Economía de Bogotá para recibir en su cuenta la información sobre nuestra programación, debe remitir un correo electrónico a la dirección seminariossemanales@banrep.gov.co con el asunto "Inscripción a la lista de correos", cabe resaltar que por esta cuenta no se reciben inscripciones a los seminarios.

- Imprimir