Evaluación de la transmisión de la tasa de interés de referencia a las tasas de interés del sistema financiero considerando las expectativas de los agentes - La tasa de interés de la tasa de la tasa de interés de referencia a las tasas de interés de la tasa de interés de referencia a las tasas de interés del sistema financiero considerando las expectativas de los agentes - La tasa de interés de la tasa de inter

de interés de referencia a las tasas de interés del sistema financiero considerando las expectativas de los agentes

Borradores de Economia

Número:

988

Publicado:

Miércoles, 1 Marzo 2017

Clasificación JEL:

D84, E43, E52, E58

Palabras clave:

Expectativas, Política monetaria, Tasas de interés, mecanismos de transmisión Descargar documento

Lo más reciente

<u>La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados</u> Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez

Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen

Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew

<u>Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost</u>

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

Otras Publicaciones

Mediante técnicas econométricas se determina si las expectativas de la tasa de interés de política y los choques no anticipados de la misma afectan las tasas de interés de captación y crédito. Se encuentra evidencia empírica de que las sorpresas monetarias tienen poder explicativo en los movimientos de tasas de mercado para las captaciones y créditos comerciales. Así mismo, se encuentra que las entidades financieras tienen en cuenta las expectativas sobre la tasa de intervención para fijar su tasa de captación. Por otro lado, se encuentra que las entidades financieras se anticipan a los movimientos de tasa de política y modifican sus tasas de captación antes del anuncio del Banco Central, y que tanto el día del anuncio como posterior a este no se realizan ajustes significativos en las tasas de mercado.

Evaluación de la transmisión de la tasa de interés de referencia a las tasas de interés del sistema financiero considerando las expectativas de los agentes