Estimación de la estructura a plazos de las tasas de interés en Colombia por medio del método de funciones B-spline cúbicas - Portal de Investigaciones Económicas Estimación de la estructura a plazos de las tasas de interés en Colombia por medio del método de funciones B-spline cúbicas

Borradores de Economia

Número:

210

Publicado:

Miércoles, 1 Mayo 2002

Clasificación JEL:

C14, C51, C52, E43

Palabras clave:

Tasas de interés, metodo de funciones B-spline cubicas 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</u> modelo XGBoost

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

Otras Publicaciones

En este documento se presenta la descripción y resultados de la estimación de la estructura a plazos de las tasas de interés en Colombia utilizando el método de funciones B-spline cúbicas. Adicionalmente, se llevan a cabo comparaciones entre los resultados obtenidos a través de esta metodología y los presentados por Arango, Melo y Vásquez (2002) respecto a los métodos de Nelson y Siegel, y de la Bolsa de Valores de Colombia. Se observa que el desempeño del método de estimación de funciones B-spline cúbicas es similar al de Nelson y Siegel y estos dos métodos superan al de la Bolsa de valores de Colombia.