Estimación de la estructura a plazo de las tasas de interés en Colombia

Borradores de Economia
Número:
196
DOI:
https://doi.org/10.32468/be.196
Publicado:
Viernes, 18 Enero 2002
Authors:
Luis E. Arango[a],
Luis Fernando Melo-Velandia[a],
Diego Vásquez-Escobar[a]
Ver más
[a]Banco de la República, Colombia
Clasificación JEL:
E43
Palabras clave:
Tasas de interés
Descargar documento

Lo más reciente

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
Otras Publicaciones

Se presenta una estimación de la estructura a plazo de las tasas de interés en Colombia, utilizando el método de Nelson y Siegel (1987). Siguiendo criterios convencionales nuestra estimación supera la curva CETES de la Bolsa de Colombia. De acuerdo con la evolución de la curva de la tasa forward, algunas interpretaciones preliminares sugieren una disminución en las expectativas de inflación a lo largo de 2001.