

Estimación de la estructura a plazo de las tasas de interés en Colombia - Portal de Investigaciones Económicas

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

Borradores de Economía

**Número:**

196

**DOI:**

<https://doi.org/10.32468/be.196>

**Publicado:**

Viernes, 18 Enero 2002

**Authors:**

[Luis E. Arango<sup>a</sup>](#),

[Luis Fernando Melo-Velandia<sup>a</sup>](#),

[Diego Vásquez-Escobar<sup>a</sup>](#)

Ver más

<sup>a</sup>Banco de la República, Colombia

**Clasificación JEL:**

E43

**Palabras clave:**

Tasas de interés

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[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.