

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^a](#),

[Luis Fernando Melo-Velandia^a](#),

[Diego Vásquez-Escobar^a](#)

Ver más

^aBanco de la República, Colombia

Clasificación JEL:

E43

Palabras clave:

Tasas de interés

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[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.