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

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

^aBanco de la República, Colombia

Clasificación JEL:

E43

Palabras clave:

Tasas de interés

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

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.