

El tramo corto de la estructura a plazo como predictor de expectativas de inflación en Colombia

Borradores de Economía

Número:

264

Publicado:

Miércoles, 1 Octubre 2003

Clasificación JEL:

E43, E31, E32, H60

Palabras clave:

Estructura a plazo, Tasas de interés, Ecuación de Fisher, Hipotesos de expectativas

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[Otras Publicaciones](#)

La evidencia empírica encontrada al explotar la ecuación de Fisher y la hipótesis de expectativas sugiere que los spreads de tasas de interés entre 12 y 24 meses y entre 6 y 12 meses contienen información que contribuye a predecir las expectativas de inflación total y de inflación núcleo. La relación entre los diferenciales de inflación y los spread de tasas de interés resultó ser positiva: cuanto mayor es el diferencial mayor es la expectativa de inflación futura.