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

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

Borradores de Economia

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 <u>Descargar documento</u>

Lo más reciente

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas <u>Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué</u> los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

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 05r es el diferencial 05r es la expectativa de inflación futura.