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
Descargar documento

Lo más reciente

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
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.