Seminario 561: La curva de rendimientos segmentada y observable: aplicación a Colombia

Seminario 561: La curva de rendimientos segmentada y observable: aplicación a Colombia
Resumen del documento: Estimamos un modelo de Nelson-Siegel segmentado de tres factores para la curva de rendimientos utilizando información diaria y observable de los precios de los TES y la IBR para Colombia. La estimación flexible de cada segmento (corto, mediano y largo plazo) proporciona ventajas sobre la estimación clásica del modelo de Nelson-Siegel, en particular dentro de la muestra. Este modelo reproduce los precios de mercado y permite incorporar ajustes locales a la estructura a plazos; características que se ajustan a las necesidades de los participantes del mercado.

Co-autores: Juan Felipe Peña (Banco Davivienda), Cristhian Rodríguez (Universidad Carlos III de Madrid)
Hora: 12:00 p. m. (refrigerio) y 12:30 p. m. (inicio del seminario)
Tiempo de exposición: 12:30 p. m. a 1:30 p. m.
Idioma de la exposición: Español

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/seminario-561-curva-rendimientos-segmentada-y-observable-aplicacion-colombia