



Affine Term Structure Models: Forecasting the Yield Curve for Colombia [

2016

text (article)

Analítica

Modelar mejor la curva de rendimientos es útil para la valoración de activos, la planeación financiera y la administración de riesgos. En este artículo se estiman cinco modelos afines de la estructura a plazos de tasas de interés para Colombia usando datos diarios. Se encuentra que un modelo de tres factores tiene un desempeño superior a los demás modelos para pronósticos intramuestrales y para pronósticos (fuera de muestra) con horizontes de uno y cinco días. Los factores del modelo se asemejan a sus contrapartes empíricas del nivel, la pendiente y la curvatura de la curva de rendimientos de Colombia

Modelar mejor la curva de rendimientos es útil para la valoración de activos, la planeación financiera y la administración de riesgos. En este artículo se estiman cinco modelos afines de la estructura a plazos de tasas de interés para Colombia usando datos diarios. Se encuentra que un modelo de tres factores tiene un desempeño superior a los demás modelos para pronósticos intramuestrales y para pronósticos (fuera de muestra) con horizontes de uno y cinco días. Los factores del modelo se asemejan a sus contrapartes empíricas del nivel, la pendiente y la curvatura de la curva de rendimientos de Colombia

<https://rebiunoda.pro.baratznet.cloud:28443/OpacDiscovery/public/catalog/detail/b2FpOmNlbGVicmF0aW9uOmVzLmJhcmF0ei5yZW4vMzM4NDE2NTA>

Título: Affine Term Structure Models: Forecasting the Yield Curve for Colombia electronic resource]

Editorial: 2016

Tipo Audiovisual: term structure forecasting interest rates multifactor models estructura a plazos pronósticos tasas de interés modelos multifactoriales

Documento fuente: Lecturas de Economía, ISSN 0120-2596, N°. 85, 2016, pags. 53-90

Nota general: application/pdf

Restricciones de acceso: Open access content. Open access content star

Condiciones de uso y reproducción: LICENCIA DE USO: Los documentos a texto completo incluidos en Dialnet son de acceso libre y propiedad de sus autores y/o editores. Por tanto, cualquier acto de reproducción, distribución, comunicación pública y/o transformación total o parcial requiere el consentimiento expreso y escrito de aquéllos. Cualquier enlace al texto completo de estos documentos deberá hacerse a través de la URL oficial de éstos en Dialnet. Más información: <https://dialnet.unirioja.es/info/derechosOAI> | INTELLECTUAL PROPERTY RIGHTS STATEMENT: Full text documents hosted by Dialnet are protected by copyright and/or related rights. This digital

object is accessible without charge, but its use is subject to the licensing conditions set by its authors or editors. Unless expressly stated otherwise in the licensing conditions, you are free to linking, browsing, printing and making a copy for your own personal purposes. All other acts of reproduction and communication to the public are subject to the licensing conditions expressed by editors and authors and require consent from them. Any link to this document should be made using its official URL in Dialnet. More info: <https://dialnet.unirioja.es/info/derechosOAI>

Lengua: English

Enlace a fuente de información: Lecturas de Economía, ISSN 0120-2596, N°. 85, 2016, pags. 53-90

Baratz Innovación Documental

- Gran Vía, 59 28013 Madrid
- (+34) 91 456 03 60
- informa@baratz.es