Seminar 561 (Only available in Spanish)

Seminar 561 (Only available in Spanish)
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-authors: *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/en/seminar-561-only-available-spanish