

## **Bibliografía**

- Arango, L., L. Melo y D. Vásquez (2002), “Estimación de la Estructura a plazo de las tasas de interés”, *Borradores de Economía*, No. 196 Banco de la República
- Brigo, D. y F. Mercurio (2001), *Interest Rate Models: Theory and Practice*, Berlin: Springer-Verlag.
- Campbell, J. Y. y R. J. Shiller, (1984), “A Simple Account of the Behavior of Long Term Interest Rates”, *American Economic Review*, Vol. 74, Núm. 44-48
- Camero, E. y S. Castellanos (2002), “¿Qué información acerca de expectativas de inflación contiene la estructura temporal de tasas de interés en México?”, *El Trimestre Económico*, Vol. 69, Núm. 275 327-353.
- Camero, E. y S. Castellanos (2003), “La estructura temporal de tasas de interés en México: ¿puede ésta predecir la actividad económica futura?”, *Revista de Análisis Económico*, 18, 33-66.
- Castellanos, Sara (2000), “El efecto del corto sobre la estructura de tasas de interés”, *Documento de investigación 2000-1*, Banco de México.
- Cox, J.C., Ingersoll, J.E. y Ross, S.A. (1985), “A Theory of the Term Structure of Interest Rates”, *Econometrica*, Vol. 53, Núm. 2 385-407.
- Culbertson, J.M. (1957), “The Term Structure of Interest Rates”, *The Quarterly Journal of Economics*, Vol.71, Núm. 4 485-517.
- Díaz de León, A. y L. Greenham (2000), “Política Monetaria y Tasas de Interés: Experiencia Reciente para el Caso de México”, *Documento de Investigación 2000-08*, Banco de México
- Diebold, F. X. y C. Li (2003) “Forecasting the Term Structure of Government of Bond Yields”, *NBER Working Paper 10048*
- Estrella, A. y G. Hardouvelis (1991), “The Term Structure as a Predictor of Real Economic Activity”, *The Journal of Finance*, Vol.46, Núm. 2 555-576.
- Estrella, A. y F. Mishkin (1995), “The Term Structure of Interest Rates and its Role in Monetary Policy for the European Central Bank”, *NBER Working Paper 5279*
- Fama, E. y R. Bliss. (1987), “The Information in Long-Maturity Forward Rates”, *American Economic Review*, Vol.77 Núm. 4 680-692.
- Fernández, V. (2000), “Estructura de Tasas de Interés en Chile. ¿Qué tan buen predictor de crecimiento e inflación?”, *Cuadernos de Economía*, Vol. 37, Núm. 111 373-404.
- Fisher, Irving (1896), “Appreciation and Interest”, *American Economic Association*,

- Vol. 11, Núm. 4 1-98.
- Hamilton, J. y D. H. Kim (2002), “A Re-examination of the Predictability of the Yield Spread for Real Economic Activity”, *Journal of Money, Credit, and Banking*, Vol. 34, Núm. 2 340-360.
- Herrera, L. y I. Magendzo (1997) “Expectativas financieras y la curva de tasas forward de Chile”, *Documentos de trabajo del Banco Central No. 23*, Banco Central de Chile.
- Hicks, J.R. (1946), *Value and Capital*, 2<sup>nd</sup> ed. London:Oxford University Press.
- Hull, John C. (2002), *Fundamentals of Futures and Options Markets*, 4<sup>th</sup> ed. New Jersey: Prentice Hall.
- Jorion, P. y F. Mishkin (1991), “A Multi-Country Comparison of Term Structure Forecasts at Long Horizons”, *NBER Working Paper 3574*
- La Conducción de la Política Monetaria a través del Régimen de Saldos Acumulados*, Banco de México.
- La Conducción de la Política Monetaria a través del Régimen de Saldos Diarios*, Banco de México
- Lutz, Friederich A. (1940), “The Structure of Interest Rates”, *The Quarterly Journal of Economics*, Vol. 55, Núm. 1 36-63.
- Lefort, F. y E. Walker (2000) “Caracterización de la estructura de tasas de interés reales en Chile”, *Economía Chilena*, 3, 31-52.
- Mankiw, N.G. (1982), “Hall’s Consumption Hypothesis and Durable Goods”, *Journal of Monetary Economics*, Vol.10, Núm. 3 417-25.
- McCulloch, J. (1971), “Measuring the Term Structure of Interest Rates”, *The Journal of Business*, Vol. 44, Núm. 1 19-31.
- McCulloch, J. (1975), “The Tax-Adjusted Yield Curve”, *The Journal of Finance*, Vol. 30, Núm. 3 811,830.
- Melino, Angelo (1986), “The Term Structures of Interest Rates: Evidence and Theory”, *NBER Working Paper 1828*.
- Mishkin, F. (1990a), “What does the Term Structure Tell Us About Future Inflation”, *Journal of Monetary Economics*, Vol. 25, Núm. 1 77-95.
- Mishkin, F. (1990b), “The information in the Longer Maturity Term Structure About Future Inflation”, *The Quarterly Journal of Economics*, Vol. 103, Núm. 3 815-828.

- Mishkin, F. (1991), "A Multi-Country Study of the Information in the Shorter Maturity Term Structure about Future Inflation", *Journal of International Money and Finance*, Vol. 10 2-22.
- Modigliani, F. y R. Sutch (1966), "Innovations in Interest Rates Policy", *American Economic Review*, Vol.56, Núm 1/2 178-197.
- Nelson, C.R. y A.F. Siegel (1987), "Parsimonious Modeling of Yield Curves," *Journal of Business*, 60, 473-489.
- Régimen de Política Monetaria*, Banco de México.
- Schich, S. (1999), "The Information content of the German term structure regarding inflation", *Applied Financial Economics*, Vol. 9, Núm. 4 385-395.
- Schwartz, Moisés J. (1998) "Consideraciones sobre la Instrumentación Práctica de la Política Monetaria", *Documento de Investigación 9804*, Banco de México
- Schwartz, M. y A. Torres (2000) "Expectativas de Inflación, Riesgo País y Política Monetaria en México", *Documento de Investigación 2000-06*, Banco de México
- Shiller, R., J. Campbell y H. Shoenholtz (1983), "Forward rates and future policy: interpreting the term structure of interest rates", *Brookings Papers on Economics Activity*, No. 1 173-223
- Soria, K. y S. Zuñiga (1999), "Estimación de la estructura temporal de tasas de interés en Chile, 1994-1997. *Universidad Católica del Norte Estudios de Administración*, Vol. 6 Núm. 1.
- Svensson, L.E.O. (1995), "Estimating Forward Interest Rates with the Extended Nelson and Siegel Method", *Sveriges Riskbank Quarterly Review*, 3, 13-26.
- Van Horne, James (1994), *Financial market rates and flows*, 4<sup>th</sup> ed. New Jersey: Prentice Hall.
- Vasicek, O. A. y Fong, H. G. (1982), "Term Structure Modeling Using Exponential Splines", *Journal of Finance*, Vol. 37 339-348.
- Wooldridge, Jeffrey (2001), *Introducción a la Econometría. Un enfoque Moderno*, México: Thomson Learning.