Recuadro 2: Relación entre el mercado de los Overnight Index Swap y el de los Títulos de Tesorería (TES) - Reporte de Mercados Financieros, Tercer trimestre de 2023

Descargar Tenga en cuenta
La principal función de estos documentos es suministrar información trimestral sobre los mercados financieros. Las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen la Junta Directiva del Banco de la República.

Autor o Editor Hincapié-Martínez, Alfredo Iván Rojas-Prieto, Diego Alejandro Rojas-Silva, Kimberly Ruiz-Cardozo, Cristhian Hernando Autores y/o editores Hincapié-Martínez, Alfredo Iván Rojas-Prieto, Diego Alejandro Rojas-Silva, Kimberly Ruiz-Cardozo, Cristhian Hernando Fecha de publicación Martes, 24 de octubre 2023

Este Recuadro estudia la relación entre el mercado de los Overnight Index Swap (OIS) y el de los títulos de Tesorería (TES). El Recuadro está compuesto de cuatro secciones, incluida esta introducción. La sección dos presenta los fundamentos y la caracterización del mercado OIS, con base en las estadísticas de la Superintendencia Financiera de Colombia (SFC). En la sección tres, se describe la relación entre el mercado OIS y el mercado de TES, presentando los resultados de varios análisis estadísticos. La última sección concluye.

Fuente: https://d1b4gd4m8561gs.cloudfront.net/es/publicaciones-investigaciones/reporte-mercados-financieros/recuadro-2-tercer-trimestre-2023