The Term-Structure of Sovereign Default Risk in Colombia and its Determinants

Borradores de Economia
Número:
709
Publicado:
Martes, 1 Mayo 2012
Clasificación JEL:
F34, G15, F37
Palabras clave:
Sovereign Default Risk, Term Structure, Emerging Markets
Descargar documento

Lo más reciente

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
Otras Publicaciones

We study the determinants of sovereign default risk in Colombia by focusing on different time spans of risk which are indicated by yield spreads of government bonds with different maturities. Cointegration regressions are performed to analyze whether the