

# Estimation of Conditional Time-

---

# Homogeneous Credit Quality Transition Matrices for Commercial Banks in Colombia

Borradores de Economía

**Número:**

560

**Publicado:**

Miércoles, 1 Abril 2009

**Clasificación JEL:**

C12, C41, E44, G21

**Palabras clave:**

Credit risk, transition probabilities, hazard functions

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas](#)

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas

[Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué los diferencia?](#)

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

[Efectividad de la política monetaria y elasticidad precio de la oferta de la vivienda en una economía emergente](#)

Martha Rosalba López-Piñeros, Eduardo Sarmiento Gómez

[Otras Publicaciones](#)

This paper presents an estimation of credit quality transition matrices for commercial banks in Colombia, using a duration hazard function model, and following the methodology proposed by Gómez-González et al (2009). Using a test developed by Weißbach et