

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

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[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