Determinantes de la rentabilidad de los bancos en Colombia: ¿importa la tasa de

Determinantes de la rentabilidad de los bancos en Colombia: ¿importa la tasa de cambio?

Borradores de Economia

Número:

556

Publicado:

Domingo, 1 Marzo 2009

Clasificación JEL:

F31, G18, G20, G21

Palabras clave:

Rentabilidad bancaria, Tasa de cambio, Regulación bancaria, Time series-cross section <u>Descargar documento</u>

Lo más reciente

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas <u>Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué</u> los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

Otras Publicaciones

En este artículo se analizan los principales determinantes de la rentabilidad de los bancos comerciales en Colombia durante el período comprendido entre 01 de 2000 y 05 de 2007. Se estiman los efectos de los movimientos en la tasa de cambio peso dólar sobre dicha rentabilidad, tanto en un momento de tiempo, como en varios. El modelo estadístico planteado implica la utilización de la metodología de Series de Tiempo de Corte Transversal (Cross-Sectional Time-Series) robusta ante la autocorrelación y la heteroscedasticidad, frecuentes en este tipo de datos. Los resultados parecen indicar que los efectos acumulados de los movimientos en la tasa de cambio sobre el retorno de los activos bancarios son estadísticamente significativos, pero bastante reducidos.