

An Alternative Methodology for Estimating Credit Quality Transition Matrices

Borradores de Economía

Número:

478

Publicado:

Sábado, 1 Diciembre 2007

Clasificación JEL:

C4, E44, G21, G23, G38

Palabras clave:

Firms, macroeconomic variables, firm-specific covariates, hazard function

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Otras Publicaciones](#)

This study presents an alternative way of estimating credit transition matrices using a hazard function model. The model is useful both for testing the validity of the Markovian assumption, frequently made in credit rating applications, and also for estim