Estimating Credit Quality Transition Matrices for the Commercial Loan Portfolio in the Colombian Financial System

Temas de Estabilidad Financiera
Número:
26
DOI:
https://doi.org/10.32468/tef.26
Publicado:
Sábado, 1 Septiembre 2007
Clasificación JEL:
G11, C13
Palabras clave:
Bancos, Crédito, Matrices de transición, Estimaciones
Descargar documento

Lo más reciente

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
Otras Publicaciones

Se hicieron diferentes estimaciones de matrices de transición para los deudores de la cartera comercial colombiana, y dependiendo de la metodología empleada, los resultados son diferentes.