

Systemic Importance Index for Financial Institutions: A Principal Component Analysis Approach

Borradores de Economía

Número:

741

DOI:

<http://doi.org/10.32468/be.741>

Publicado:

Miércoles, 24 Octubre 2012

Clasificación JEL:

D85, C63, E58, G28

Palabras clave:

Systemic Importance, systemic risk, Principal Components Analysis, too-connected-to-fail

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Modelo Fiscal Colombiano para la Evaluación Económica](#)

Andrés Nicolás Herrera-Rojas, David Camilo López-Valenzuela, Juan José Ospina-Tejeiro, Jesús Antonio Bejarano-Rojas

[Mitos y realidades del Catatumbo](#)

Jaime Alfredo Bonet-Moron, Yuri Carolina Reina-Aranza, Adriana Ortega, Ana Rosa Polanco

[Explorando la relación entre aportes netos de capital y rentabilidad en los fondos de inversión colectiva abiertos sin pacto de permanencia en Colombia](#)

Juan Sebastián Mariño-Montaña, Daniela Rodriguez-Novoa, Camilo Eduardo Sánchez-Quiroga

[Otras Publicaciones](#)

As a result of the most recent global financial crisis literature has embraced size, connectedness and substitutability as key indicators for financial institutions' systemic importance. Despite the intuitiveness of these concepts, identifying systemic im