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

Borradores de Economia
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

Apropiación digital y desigualdad económica en Colombia
Olga Lucia Acosta Navarro, Olga Lucia Acosta Navarro, Marlon Angulo-Ramos, Ana María Iregui-Bohórquez, María Teresa Ramírez-Giraldo
Estimación de densidad estacionaria para modelos ARCH con aplicaciones en regresión cuantílica
Manuel Darío Hernández-Bejarano, Zhibiao Zhao
De los choques climáticos al riesgo financiero: un marco aplicado al sector hidroeléctrico colombiano
Daniela Rodriguez-Novoa, María José Vélez-Rodríguez
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