Macro-prudential assessment of Colombian financial institutions' systemic importance

Borradores de Economia
Número:
800
DOI:
http://doi.org/10.32468/be.800
Publicado:
Jueves, 24 Octubre 2013
Clasificación JEL:
D85, C63, E58, G28
Palabras clave:
Systemic Importance, systemic risk, Fuzzy Logic, principal component analysis
Descargar documento

Lo más reciente

Estimación de densidad estacionaria para modelos ARCH con aplicaciones en regresión cuantílica
Manuel Darío Hernández-Bejarano, Zhibiao Zhao
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Otras Publicaciones

This document presents an enhanced and condensed version of preceding proposals for identifying systemically important financial institutions in Colombia. Three systemic importance metrics are implemented: (i) money market net exposures network hub centra