Análisis de estrés sobre el sistema bancario colombiano: un escenario conjunto de

Análisis de estrés sobre el sistema bancario colombiano: un escenario conjunto de riesgos

Temas de Estabilidad Financiera

Número:

36

DOI:

https://doi.org/10.32468/tef.36

Publicado:

Lunes, 1 Septiembre 2008

Palabras clave:

Bancos, Prueba de estrés, Riesgo, Vulnerabilidad Descargar documento

Lo más reciente

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas <u>Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué</u> los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

Otras Publicaciones

En este documento se presenta una aplicación al sistema bancario colombiano de la metodología de prueba de estrés propuesta por Cihák (2007). El análisis de las posibles consecuencias generadas por diversos choques económicos sobre el sistema bancario se desarrolla involucrando cinco factores de riesgo individuales: de crédito, de tasa de interés, de tipo de cambio, de contagio interbancario y de liquidez. Se resalta la importancia del monitoreo conjunto de los riesgos y la generación de escenarios de estrés que involucren choques simultáneos sobre el sistema. Con este tipo de análisis se logra caracterizar las mayores vulnerabilidades de la estructura bancaria, así como identificar a las entidades que presentan mayores debilidades.