

# Aproximación cuantitativa a la

# centralidad de los bancos en el mercado interbancario: enfoque de juegos cooperativos

Temas de Estabilidad Financiera

**Número:**

37

**DOI:**

<https://doi.org/10.32468/tef.37>

**Publicado:**

Lunes, 1 Septiembre 2008

**Palabras clave:**

Estabilidad financiera, Teoría de juegos cooperativos, Riesgo de liquidez, Posición relativa en mercados con red observable

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Revista Ensayos Sobre Política Económica - Explorando las brechas de género en Colombia](#)

María Teresa Ramírez-Giraldo, Karina Acosta, Olga Lucia Acosta Navarro, Lucia Arango-Lozano, Fernando Arias-Rodríguez, Oscar Iván Ávila-Montealegre, Oscar Reinaldo Becerra Camargo, Leonardo Bonilla-Mejía, Grey Yuliet Ceballos-García, Luz Adriana Flórez, Juan Miguel Gallego-Acevedo, Luis Armando Galvis-Aponte, Luis M. García-Pulgarín, Andrés Felipe García-Suaza, Anderson Grajales, Daniela Gualtero-Briceño, Didier Hermida-Giraldo, Ana María Iregui-Bohórquez, Juliana Jaramillo-Echeverri, Karen Laguna-Ballesteros, Francisco Javier Lasso-Valderrama, Daniel Márquez, Carlos Alberto Medina-Durango, Ligia Alba Melo-Becerra, María Fernanda Meneses-González, Juan José Ospina-Tejeiro, Andrea Sofía Otero-Cortés, Daniel Parra-Amado, Juana Piñeros-Ruiz, Christian Manuel Posso-Suárez, Natalia Ramírez-Bustamante, Mario Andrés Ramos-Veloz, Jorge Leonardo Rodríguez-Arenas, Alejandro Sarasti-Sierra, Bibiana Taboada-Arango, Ana María Tribín-Uribe, Juanita Villaveces

[Otras Publicaciones](#)

En este trabajo se propone una metodología para cuantificar la centralidad de los agentes que participan en el mercado interbancario, bajo un enfoque de juegos cooperativos. La metodología utiliza diferencias de valores de Shapley en juegos de transacciones con y sin restricciones de red observable, y permite construir series de tiempo para cada agente, que identifican la posición relativa de cada uno frente al mercado. Por último, se analizan propiedades del indicador y su relación con variables relacionadas con riesgo de liquidez. Se

Aproximación cuantitativa a la centralidad de los bancos en el mercado interbancario: enfoque de juegos cooperativos

## **Aproximación cuantitativa a la centralidad de los bancos en el mercado interbancario: enfoque de juegos cooperativos - Portal de Investigaciones Económicas**

encuentra que para el caso del SEN hay una relación entre un indicador de dispersión de red y los bid-ask spread de los TES en bandas líquidas.

---