

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

[Dinámica Salarial, Desempleo e Inflación: Extendiendo el Modelo Semi-Estructural 4GM](#)

Mario Andrés Ramos-Veloza, Sara Naranjo-Saldarriaga, José Pulido

[Índices de Sentimiento e Incertidumbre de las noticias económicas de Colombia](#)

Rocío Clara Alexandra Mora-Quiñones, Antonio José Orozco-Gallo, Dora Alicia Mora-Pérez

[Billeteras móviles y otros servicios de pago: brechas regionales y su adopción en Colombia](#)

Constanza Martínez-Ventura, Ligia Alba Melo-Becerra

[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 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.