

# 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

[Tasa de interés de política monetaria de Colombia: Sus expectativas y el traspaso a las tasas de CDTs y de créditos](#)

Julián Alonso Cárdenas-Cárdenas, Deicy Johana Cristiano-Botia, Eliana Rocío González-Molano, Carlos Alfonso Huertas-Campos

[Revista Ensayos Sobre Política Económica - Características cuantitativas de los ciclos económicos en Colombia](#)

Luis E. Arango, Juan José Ospina-Tejeiro, Fernando Arias-Rodríguez, Oscar Iván Ávila-Montealegre, Jaime Andrés Collazos-Rodríguez, Diana M. Cortázar Gómez, Juan Pablo Cote-Barón, Julio Escobar-Potes, Aarón Levi Garavito-Acosta, Franky Juliano Galeano-Ramírez, Eliana Rocío González-Molano, María Camila Gomez Cardona, Anderson Grajales, David Camilo López-Valenzuela, Wilmer Martínez-Rivera, Nicolás Martínez-Cortés, Rocío Clara Alexandra Mora-Quiñones, Sara Naranjo-Saldarriaga, Antonio Orozco, Daniel Parra-Amado, Julián Pérez-Amaya, José Pulido, Karen L. Pulido-Mahecha, Carolina Ramírez-Rodríguez, Sergio Restrepo Ángel, José Vicente Romero-Chamorro, Nicol Valeria Rodríguez-Rodríguez, Norberto Rodríguez-Niño, Diego Hernán Rodríguez-Hernández, Carlos D. Rojas-Martínez, Johana Andrea Sanabria-Domínguez, Diego Vásquez-Escobar

[Disparidades regionales en los precios de arrendamiento de vivienda urbana en Colombia: una evaluación empírica](#)

Luis Armando Galvis-Aponte, Adriana Isabel Ortega-Arrieta, Adriana Marcela Rivera-Zárate

[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

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

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.