

Índice de estabilidad financiera para Colombia - Portal de Investigaciones Económicas

Índice de estabilidad financiera para Colombia

Temas de Estabilidad Financiera

Número:

38

DOI:

<https://doi.org/10.32468/tef.38>

Publicado:

Martes, 5 Mayo 2009

Palabras clave:

Índices de estrés bancario, Instituciones financieras, Monitoreo, Fragilidad financiera

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[Otras Publicaciones](#)

Los desequilibrios en los sistemas financieros actuales y de finales de los años noventa, evidenciaron una vez más los enormes costos económicos y sociales generados por los periodos de inestabilidad financiera. De allí que la construcción de índices de estrés haya empezado a ser ampliamente desarrollada como alternativa para evaluar la calidad de los sistemas financieros en el mundo. El objetivo de este documento es desarrollar un índice continuo y cuantificable con la capacidad de determinar el nivel de estrés del sistema financiero colombiano teniendo en cuenta consideraciones de rentabilidad, liquidez y probabilidad de incumplimiento. Las metodologías utilizadas abarcan la aproximación de igualdad de varianza, los componentes principales, y en general modelos para datos de conteo. Los resultados muestran que el índice logra determinar el nivel de estrés contemporáneo del sistema tanto de manera global como desagregada. Asimismo, se desarrollaron pronósticos del índice de estabilidad financiera (IEFI) usando algunas variables macroeconómicas relevantes.