

# 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

[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-Urbe, Juanita Villaveces

[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

Índice de estabilidad financiera para Colombia

## Índice de estabilidad financiera para Colombia - Portal de Investigaciones

### Económicas

desarrollaron pronósticos del índice de estabilidad financiera (IEFI) usando algunas variables macroeconómicas relevantes.

---