Una aproximación para analizar la estabilidad financiera por medio de un DSGE

Temas de Estabilidad Financiera
Número:
40
DOI:
https://doi.org/10.32468/tef.40
Publicado:
Viernes, 1 Mayo 2009
Palabras clave:
Modelo DSGE, Estabilidad financiera, Política monetaria, Regulación
Descargar documento

Lo más reciente

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
Otras Publicaciones

En este trabajo se presenta un modelo de equilibrio general dinámico y estocástico para analizar la estabilidad financiera de una economía cerrada y sin gobierno. El modelo se basa en el propuesto por Leao y Leao (2007), adicionando un incumplimiento endógeno del pago de la deuda por parte de los hogares y un requerimiento de provisiones para los bancos. Así se permite analizar el impacto que tienen cambios en algunas medidas de política monetaria y regulatorias sobre la estabilidad financiera. Los resultados sugieren que una política monetaria contraccionista puede tener implicaciones positivas en términos de estabilidad financiera.