

¿Cómo caracterizar entidades sistémicas?: medidas de impacto sistémico para Colombia

Temas de Estabilidad Financiera

Número:

65

DOI:

<https://doi.org/10.32468/tef.65>

Publicado:

Jueves, 1 Marzo 2012

Clasificación JEL:

G18, E58, L51

Palabras clave:

Estabilidad financiera, Riesgo sistémico, Teoría del valor extremo, Ejercicio de estrés

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Impacto fiscal del cambio demográfico sobre la educación en Colombia](#)

Olga Lucia Acosta Navarro, Andrés Felipe Chitán-Caes, Ana María Iregui-Bohórquez, Ligia Alba Melo-Becerra, María Teresa Ramírez-Giraldo, Jorge Leonardo Rodríguez Arenas

[Transferencias regionales no-condicionadas: el caso de regiones ribereñas en un país en desarrollo](#)

Bernardo Romero-Torres, Gerson Javier Pérez-Valbuena, Andrés Felipe García-Suaza, Jaime Alfredo Bonet-Moron

[La Efectividad de los Fondos de Recursos Naturales: Evidencia para Colombia](#)

Alejandro Ome, Laura Giles Álvarez, Gerson Javier Pérez-Valbuena, Cristhian Larrahondo

[Otras Publicaciones](#)

Este trabajo hace una contribución a la caracterización de las entidades sistémicas así como las vías mediante las cuales este riesgo se presenta en el sistema. Inicialmente, siguiendo la metodología propuesta por Zhou (2010), se estiman y analizan indicadores de riesgo sistémico para los establecimientos de crédito en Colombia y se estudia cuál es la relación de estas medidas con el tamaño de las entidades en el sistema y el nivel de interconexión en el mercado interbancario. Finalmente se realiza un ejercicio de estrés y se analiza el efecto del mismo en los indicadores de importancia sistémica calculados.