

¿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

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

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

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[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.