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

¿Como 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

<u>La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados</u> Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez

Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen

Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew

<u>Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un</u> modelo XGBoost

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

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.