Tema núm. 65

Autor o Editor

Mariana Laverde Javier Gutiérrez Rueda

Autores y/o editores

Laverde, Mariana

(Documento actualizado:31/05/2012/11:30 a.m.)

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.