Riesgo de mercado - Informe especial de Estabilidad Financiera - Septiembre de 2014

Descargar Tenga en cuenta
La principal función de estos informes es hacer seguimiento a las vulnerabilidades y riesgos del sistema financiero. Las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen la Junta Directiva del Banco de la República.

Autor o Editor Cabrera-Rodríguez, Wilmar Alexander Quicazán-Moreno, Carlos Andrés Jaulín-Méndez, Oscar Fernando Segovia-Baquero, Santiago David
Los informes especiales de estabilidad financiera acompañan la publicación del Reporte de Estabilidad Financiera y proveen un análisis más detallado de algunos aspectos y riesgos relevantes para la estabilidad del sistema financiero colombiano: riesgo de liquidez de mercado, riesgo de mercado, riesgo de crédito, carga financiera, cartera y mercado de vivienda en Colombia, indicadores internacionales, concentración y competencia en los mercados de depósito y crédito, encuestas al sector corporativo e inclusión financiera.

Fecha de publicación Martes, 16 de diciembre 2014
En este informe se analiza la exposición que tienen las entidades del sistema financiero ante variaciones en los precios de los TES en su portafolio de inversiones. Para lo anterior, el análisis se divide en cuatro secciones. En la primera se observa la exposición del sistema a los títulos de deuda pública; en la segunda se realizan dos ejercicios de sensibilidad con el fin de evaluar la capacidad de las entidades para absorber choques adversos; en la tercera se calcula una medida de riesgo de mercado y, por último, se estima el incremento en el riesgo de mercado del sistema ocasionado por cada entidad.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/riesgo-mercado-informe-especial-estabilidad-financiera-septiembre-2014