Riesgo de liquidez - Informe especial de Estabilidad Financiera - Marzo de 2017

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 Hurtado-Guarín, Jorge Luis Meneses-González, María Fernanda 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 Miércoles, 4 de octubre 2017
Monitorear la liquidez de mercado es importante en la medida en que permite a las entidades efectuar distintas operaciones de manera oportuna, evitando posibles pérdidas asociadas a fluctuaciones en los precios de sus activos. Adicionalmente, los problemas de liquidez de una entidad pueden amenazar la estabilidad del sistema financiero si una proporción importante de las transacciones dependen del pago oportuno de sus obligaciones.

En el presente Informe se analizan aspectos de la liquidez de mercado del sistema financiero concernientes al mercado de títulos de deuda publica en Colombia (TES) y al mercado monetario. En la primera sección se evalúa la liquidez de los TES —los cuales conforman el segundo activo más importante de los establecimientos de crédito (EC) después de la cartera— mediante su bid-ask spread (bas), así como la profundidad del mercado. En la segunda sección se caracteriza el mercado monetario colombiano a partir del análisis de redes con el fin de identificar y contar con un mayor entendimiento de la estructura y las relaciones de los agentes.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/riesgo-liquidez-informe-especial-estabilidad-financiera-marzo-2017