Liquidez de mercado - Informe Especial de Estabilidad Financiera - primer semestre 2020

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.

Autores y/o editores Meneses-González, María Fernanda Sánchez-Quinto, Camilo Eduardo
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, 1 de julio 2020
El monitoreo de las condiciones de liquidez de los mercados ?nancieros permite identi?car posibles contingencias que pueda enfrentar una entidad al momento de acceder u otorgar recursos, y que a su vez, puedan amenazar la estabilidad del sistema ?nanciero 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 ?nanciero concernientes al mercado de títulos de deuda pública en Colombia (TES) y al mercado monetario, haciendo énfasis en el análisis de las condiciones de los mercados en el contexto de emergencia sanitaria que atraviesa la economía. En la primera sección se evalúa la liquidez de los TES (los cuales conforman el segundo activo más importante de los establecimientos de crédito después de la cartera) a través del análisis de medidas como el bid-ask spread (bas) y la profundidad del mercado. En la segunda sección se presenta una caracterización del mercado monetario colombiano a partir de un análisis de redes, con el ?n de identi?car su estructura y estudiar las relaciones entre los agentes durante el surgimiento de la crisis sanitaria.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/publicaciones-investigaciones/informes-especiales-estabilidad-financiera/liquidez-mercado-primer-semestre-2020