Liquidez de mercado - Informe Especial de Estabilidad Financiera - segundo 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 Sánchez-Quinto, Camilo Eduardo 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, 29 de diciembre 2020
El análisis de las condiciones de liquidez de los mercados financieros permite entender las dinámicas que los agentes presentan en el sistema de pagos y cómo choques externos las pueden haber afectado. Por esta razón, en el presente Informe se analizan aspectos de la liquidez de mercado del sistema financiero colombiano concernientes al mercado de títulos de deuda pública (TES) y al mercado monetario. En la primera sección se evalúa la liquidez de los TES (los cuales representan 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 fin de identificar su estructura, analizar su dinámica reciente y estudiar las relaciones entre los agentes durante el último semestre.

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