Descargar

Autor o Editor
Rodriguez-Novoa, Daniela
Yanquen, 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 de 2020

El propósito del presente informe es medir la transmisión de volatilidad que existe entre los mercados de deuda pública, deuda privada y acciones, de manera que se pueda identificar si un mercado, en determinado momento del tiempo, fue generador o receptor de volatilidad. Posteriormente, se estima el valor en riesgo (VeR) a un día del portafolio en posición propia de los tres mercados, así como los efectos de una posible materialización del riesgo de mercado sobre el balance de las entidades.