

# **Riesgo de mercado - Informe especial de Estabilidad Financiera - Marzo de 2017**

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 Jaulín-Méndez, Oscar Fernando Mariño-Montaña, Juan Sebastián 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 Viernes, 22 de septiembre 2017

El propósito del presente informe especial 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 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.