Seminario 517. SYSMO I: Modelo de Estrés para el Sistema Financiero Colombiano

Seminario 517. SYSMO I: Modelo de Estrés para el Sistema Financiero Colombiano
Departamento de Estabilidad Financiera, Banco de la República

Co-autores: Daniel Osorio, Oscar Jaulín, Juan Carlos Mendoza, Paola Morales, Eduardo Yanquen (Banco de la República)

Entrada libre. Indispensable inscribirse en el siguiente vínculo: Inscripciones

Hora: 12:00 m. (refrigerio) y 12:30 p. m. (inicio del seminario)
Tiempo de exposición: 12:30 p. m. a 2:00 p. m.
Lugar: Banco de la República, carrera 7 # 14-78, piso 13 (Sala de prensa), Bogotá D.C.
Idioma de la exposición: Español

Resumen del documento: Este artículo presenta la primera versión del SYSMO, la herramienta de análisis empleada por el Departamento de Estabilidad Financiera del Banco de la República para realizar el ejercicio de estrés top-down semestralmente. El modelo comprende: (i) un módulo que genera escenarios de estrés macroeconómico internamente consistentes, (ii) un conjunto de modelos satélite que estiman la materialización de los riesgos de crédito y de mercado en períodos de estrés, y (iii) un modelo bancario que simula la respuesta endógena de los establecimientos de crédito al escenario adverso. El modelo también incorpora los riesgos de fondeo y contagio de manera endógena, ciertas restricciones regulatorias (solvencia y liquidez), y efectos de segunda vuelta entre las decisiones de las entidades financieras y el escenario macroeconómico. Los resultados del SYSMO que se presentan en este artículo corresponden al ejercicio de estrés publicado en el Reporte de Estabilidad Financiera del segundo semestre de 2017.

Image not found or type unknown
PDF icon SYSMO I: A Systemic Stress Model for the Colombian Financial System

Si desea inscribirse a la lista de correos del Seminario semanal de Economía de Bogotá para recibir en su cuenta la información sobre nuestra programación, debe remitir un correo electrónico a la dirección seminariossemanales@banrep.gov.co con el asunto "Inscripción a la lista de correos", cabe resaltar que por esta cuenta no se reciben inscripciones a los seminarios.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/eventos/seminario-semanal-economia-bogota-517