Liquidez de mercado - Informe especial de Estabilidad Financiera - Segundo semestre 2019

Descargar Autor o Editor Meneses-González, María Fernanda Sánchez, Camilo Eduardo
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. 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.

Fecha de publicación Jueves, 26 de diciembre 2019
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. 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.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/liquidez-mercado-informe-especial-estabilidad-financiera-segundo-semestre-2019