<u>Descargar</u>
Tenga en cuenta
Toriga on oderita
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
Rodriguez-Novoa, Daniela Yanquen, Eduardo
Los <u>informes especiales de estabilidad financiera</u> 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, 01 julio 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 e 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.