



BANCO CENTRAL EUROPEO

7 de enero de 2010

NOTA DE PRENSA

RESUMEN DE UN SEMINARIO SOBRE LOS AVANCES RECIENTES EN LA MODELIZACIÓN DEL RIESGO SISTÉMICO UTILIZANDO ANÁLISIS DE REDES

En octubre de 2009, se celebró en el Banco Central Europeo (BCE) un seminario titulado «Recent advances in modelling systemic risk using network analysis». En el día de hoy, el BCE publica un resumen del seminario, al que asistieron expertos de bancos centrales y de organizaciones internacionales que trabajan en los campos de la estabilidad financiera y del análisis/vigilancia de los sistemas de pago

La crisis financiera internacional ilustra claramente el papel de los vínculos financieros como canal de propagación de las perturbaciones al sistema financiero y dentro del mismo. La investigación llevada a cabo recientemente en el área del análisis de redes ha mostrado que la modelización y la simulación de las exposiciones que interrelacionan a las instituciones financieras y los sectores de la economía o a los sistemas financieros nacionales pueden poner de manifiesto las vulnerabilidades que no se hubieran podido detectar de otro modo. El objetivo de este seminario fue intercambiar puntos de vista y experiencias en el campo del análisis de redes financieras, así como profundizar en el conocimiento de la modelización de redes en general y de las posibilidades y limitaciones en este área de análisis.

En el seminario se puso de relieve el potencial de la teoría de redes para mejorar las herramientas que se utilizan en el análisis macroprudencial, la vigilancia de la infraestructura de mercado y la gestión de riesgos de contraparte, y se propusieron nuevas vías de investigación. Un resumen de este seminario puede consultarse en la dirección del BCE.

Banco Central Europeo

Dirección de Comunicación

División de Prensa e Información

Kaiserstrasse 29, D-60311 Frankfurt am Main

Tel.: +49 69 1344 7455, Fax: +49 69 1344 7404

Internet: <http://www.ecb.europa.eu>

Se permite su reproducción, siempre que se cite la fuente