

Short-Term Liquidity Contagion in the Interbank Market - Portal de Investigaciones Económicas

Short-Term Liquidity Contagion in the Interbank Market

Borradores de Economía

Número:

920

Publicado:

Martes, 1 Diciembre 2015

Clasificación JEL:

G21, L14, C63

Palabras clave:

Financial Networks, Contagion, default, Liquidity

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

We implement a modified version of DebtRank, a measure of systemic impact inspired in feedback centrality, to recursively measure the contagion effects caused by the default of a selected financial institution. In our case contagion is a liquidity issue,