

Estimating financial institutions' intraday liquidity risk : a Monte Carlo simulation approach - Portal de Investigaciones Económicas

Estimating financial institutions' intraday liquidity risk : a Monte Carlo simulation approach

Borradores de Economía

Número:

703

Publicado:

Domingo, 1 Abril 2012

Clasificación JEL:

C15, C63, E47, G17, D81

Palabras clave:

Payments systems, Intraday, liquidity risk, Bivariate Poisson process

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Otras Publicaciones](#)

The most recent financial crisis unveiled that liquidity risk is far more important and intricate than regulation have conceived. The shift from bank-based to market-based financial systems and from Deferred Net Systems to liquidity-demanding Real-Time Gr