

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

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[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