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

Borradores de Economia
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

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
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