A Market Risk Approach to Liquidity Risk and Financial Contagion

Borradores de Economia
Número:
384
Publicado:
Miércoles, 1 Marzo 2006
Clasificación JEL:
G21, G33, L14
Palabras clave:
Liquidity manager, liquidity risk, market risk, systemic risk
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

According to traditional literature, liquidity risk in individual banks can turn into a system-wide financial crisis when either interbank credit exposures or bank runs are present. This paper shows that this phenomenon can also arise when individual liqu