

A Market Risk Approach to Liquidity Risk and Financial Contagion

Borradores de Economía

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

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[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