

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

[Simulación dinámica de balances y predicción del incumplimiento crediticio: un modelo de prueba de estrés para firmas colombianas](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Gómez-Molina Andrés Camilo

[Modelo Fiscal Colombiano para la Evaluación Económica](#)

Andrés Nicolás Herrera-Rojas, David Camilo López-Valenzuela, Juan José Ospina-Tejeiro, Jesús Antonio Bejarano-Rojas

[Mitos y realidades del Catatumbo](#)

Jaime Alfredo Bonet-Moron, Yuri Carolina Reina-Aranza, Adriana Ortega, Ana Rosa Polanco

[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