

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

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[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