

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

[Leyes de márgenes mínimos y fijación de precios en comercios multiproducto](#)

Daniel Herrera-Araujo, Jorge Florez-Acosta

[Trabajo de cuidado no remunerado y brechas regionales de género en la participación laboral en Colombia](#)

Luis Armando Galvis-Aponte, Adriana Marcela Rivera-Zárate

[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

[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