

A dynamic approach to intraday liquidity needs

Borradores de Economía

Número:

877

Publicado:

Domingo, 1 Marzo 2015

Clasificación JEL:

D53, D85, E51, C63, G21, G23

Palabras clave:

Large Value Payment System, Intraday Liquidity, Counterparty Stress Test, Discretionary Payments

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

This paper presents a methodology to estimate the intraday liquidity that systemically important entities (SIE) need to fulfill all its obligations in a timely fashion, when a simulated failure-to-pay from its main liquidity supplier by discretionary conc