

Comparison of Methods for Estimating the Uncertainty of Value at Risk

Número:

927

Publicado:

Lunes, 1 Febrero 2016

Clasificación JEL:

C51, C52, C53, G32

Palabras clave:

value at risk, Confidence Intervals, data tilting, Subsample Bootstrap

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Mitos y realidades del Catatumbo](#)

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

[Explorando la relación entre aportes netos de capital y rentabilidad en los fondos de inversión colectiva abiertos sin pacto de permanencia en Colombia](#)

Juan Sebastián Mariño-Montaña, Daniela Rodríguez-Novoa, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Un Enfoque de Dependencia y Nivel para Evaluar el Desanclaje de las Expectativas de Inflación: Evidencia de Colombia](#)

Jonathan Muñoz-Martínez

[Otras Publicaciones](#)

Value at Risk (VaR) is a market risk measure widely used by risk managers and market regulatory authorities. There is a variety of methodologies proposed in the literature for the estimation of VaR. However, few of them get to say something about its dist