

Comparison of Methods for Estimating the Uncertainty of Value at Risk

Borradores de Economía

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

[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](#)

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