

El valor en riesgo ajustado por liquidez en Colombia

Temas de Estabilidad Financiera

Número:

25

DOI:

<https://doi.org/10.32468/tef.25>

Publicado:

Jueves, 1 Marzo 2007

Palabras clave:

Bancos, Riesgo, Precios, Volatilidad

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[Otras Publicaciones](#)

Se utiliza la metodología de VeRL para incluir el riesgo de liquidez en las mediciones condicionales de riesgo de Mercado en Colombia, para ello se presenta y se utiliza una versión multivariada de la metodología, la cual hace uso explícito de la correlación entre las puntas y los precios de mercado de distintos instrumentos.