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

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
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.