

# 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

[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](#)

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.