

Una aproximación dinámica a la medición del riesgo de mercado para los bancos comerciales en Colombia - Portal de Investigaciones Económicas

# Una aproximación dinámica a la medición del riesgo de mercado para los bancos comerciales en Colombia

Temas de Estabilidad Financiera

**Número:**

31

**DOI:**

<https://doi.org/10.32468/tef.31>

**Publicado:**

Sábado, 1 Marzo 2008

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Revista Ensayos Sobre Política Económica - Explorando las brechas de género en Colombia](#)

María Teresa Ramírez-Giraldo, Karina Acosta, Olga Lucia Acosta Navarro, Lucia Arango-Lozano, Fernando Arias-Rodríguez, Oscar Iván Ávila-Montealegre, Oscar Reinaldo Becerra Camargo, Leonardo Bonilla-Mejía, Grey Yuliet Ceballos-García, Luz Adriana Flórez, Juan Miguel Gallego-Acevedo, Luis Armando Galvis-Aponte, Luis M. García-Pulgarín, Andrés Felipe García-Suaza, Anderson Grajales, Daniela Gualtero-Briceño, Didier Hermida-Giraldo, Ana María Iregui-Bohórquez, Juliana Jaramillo-Echeverri, Karen Laguna-Ballesteros, Francisco Javier Lasso-Valderrama, Daniel Márquez, Carlos Alberto Medina-Durango, Ligia Alba Melo-Becerra, María Fernanda Meneses-González, Juan José Ospina-Tejeiro, Andrea Sofía Otero-Cortés, Daniel Parra-Amado, Juana Piñeros-Ruiz, Christian Manuel Posso-Suárez, Natalia Ramírez-Bustamante, Mario Andrés Ramos-Veloz, Jorge Leonardo Rodríguez-Arenas, Alejandro Sarasti-Sierra, Bibiana Taboada-Arango, Ana María Tribín-Uribe, Juanita Villaveces

[El Sistema de Cuentas Nacionales por Sector Institucional: una mirada metodológica al caso colombiano](#)

Carlos David Ardila-Dueñas, Joel Santiago Castellanos-Caballero, Carlos David Murcia-Bustos

[Otras Publicaciones](#)

En este artículo se describe la metodología utilizada para la medición del riesgo de mercado llevada a cabo en el Reporte de Estabilidad Financiera, mediante el uso de técnicas dinámicas no sólo en la modelación de volatilidades sino también de correlaciones. La medida de Valor en Riesgo (VeR) se calculó individualmente para los bancos comerciales con periodicidad semanal entre febrero de 2003 y febrero de 2008. Los cálculos de los VeR estáticos y dinámicos muestran diferencias cuantitativas significativas en períodos de turbulencia, lo que resalta la importancia de las nuevas medidas de riesgo propuestas.