

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

[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](#)

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.