

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

[Impacto fiscal del cambio demográfico sobre la educación en Colombia](#)

Olga Lucia Acosta Navarro, Andrés Felipe Chitán-Caes, Ana María Iregui-Bohórquez, Ligia Alba Melo-Becerra, María Teresa Ramírez-Giraldo, Jorge Leonardo Rodríguez Arenas

[Transferencias regionales no-condicionadas: el caso de regiones ribereñas en un país en desarrollo](#)

Bernardo Romero-Torres, Gerson Javier Pérez-Valbuena, Andrés Felipe García-Suaza, Jaime Alfredo Bonet-Moron

[La Efectividad de los Fondos de Recursos Naturales: Evidencia para Colombia](#)

Alejandro Ome, Laura Giles Álvarez, Gerson Javier Pérez-Valbuena, Cristhian Larrahondo

[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.