

# MODELO ESTOCÁSTICO PARA EL SPREAD EN PRESENCIA DE FLUCTUACIONES DE LIQUIDEZ

José Javier Cerda

FIEECS-UNI, Perú

josecehe@gmail.com

En el presente trabajo, en base a evidencia empírica, proponemos un modelo estocástico para explicar las fluctuaciones grandes en los precios en los activos ante fluctuaciones de liquidez en los mercados. Además, presentaremos algunas propiedades del modelo y evidenciamos algunos hechos empíricos reportados en diversos trabajos.