

Análisis de riesgo en la inversión financiera

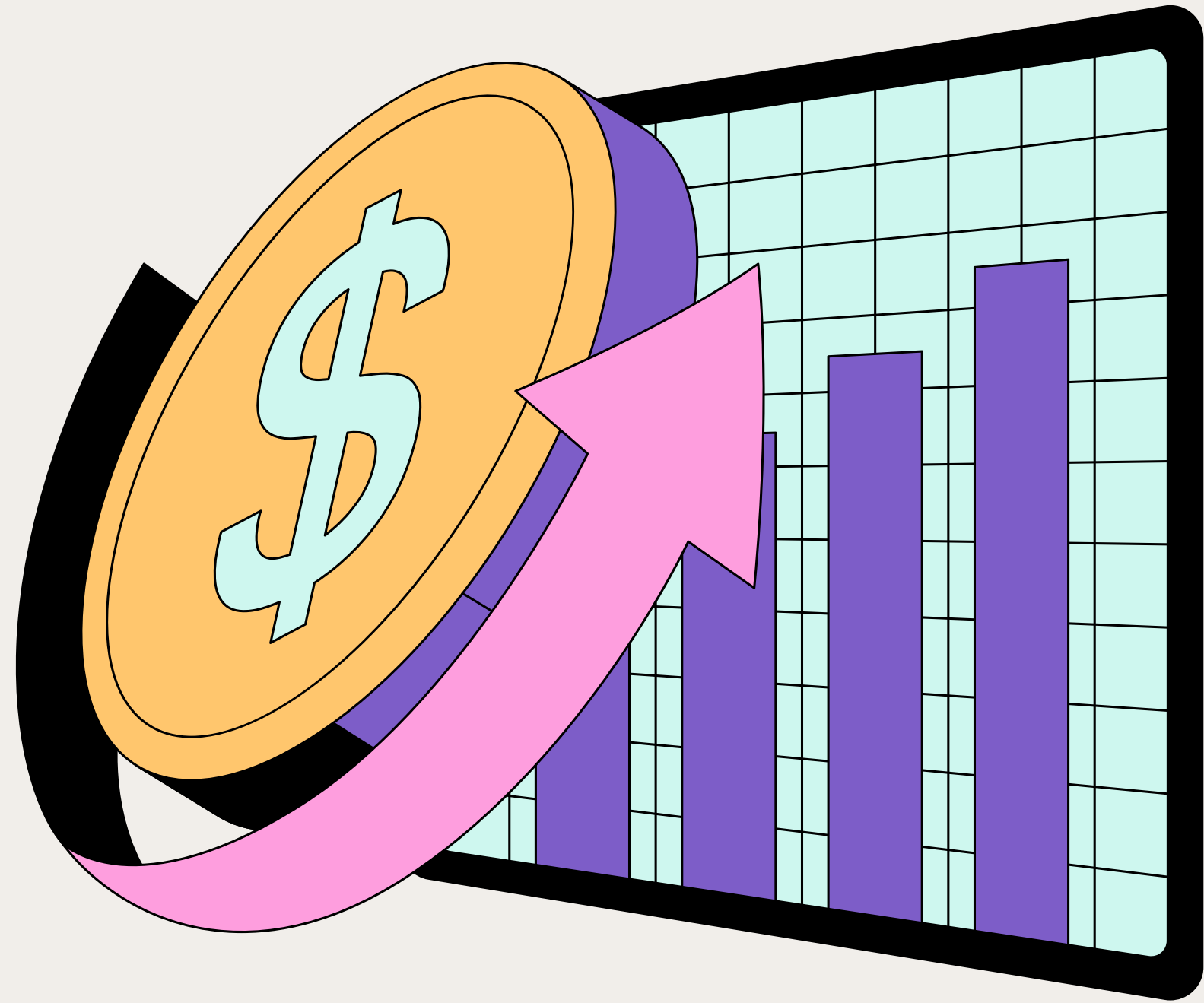
Integrantes

Jeremy Flores Bonilla

Dominick Rodríguez Trejos

Cristhofer Urrutia Cascante

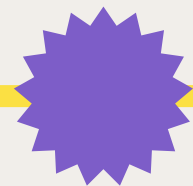
Gabriel Valverde Guzmán



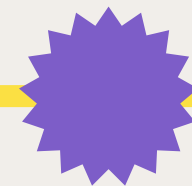
Tareas del Sprint #4



Calcular VaR y
CVaR con POT +
GPD

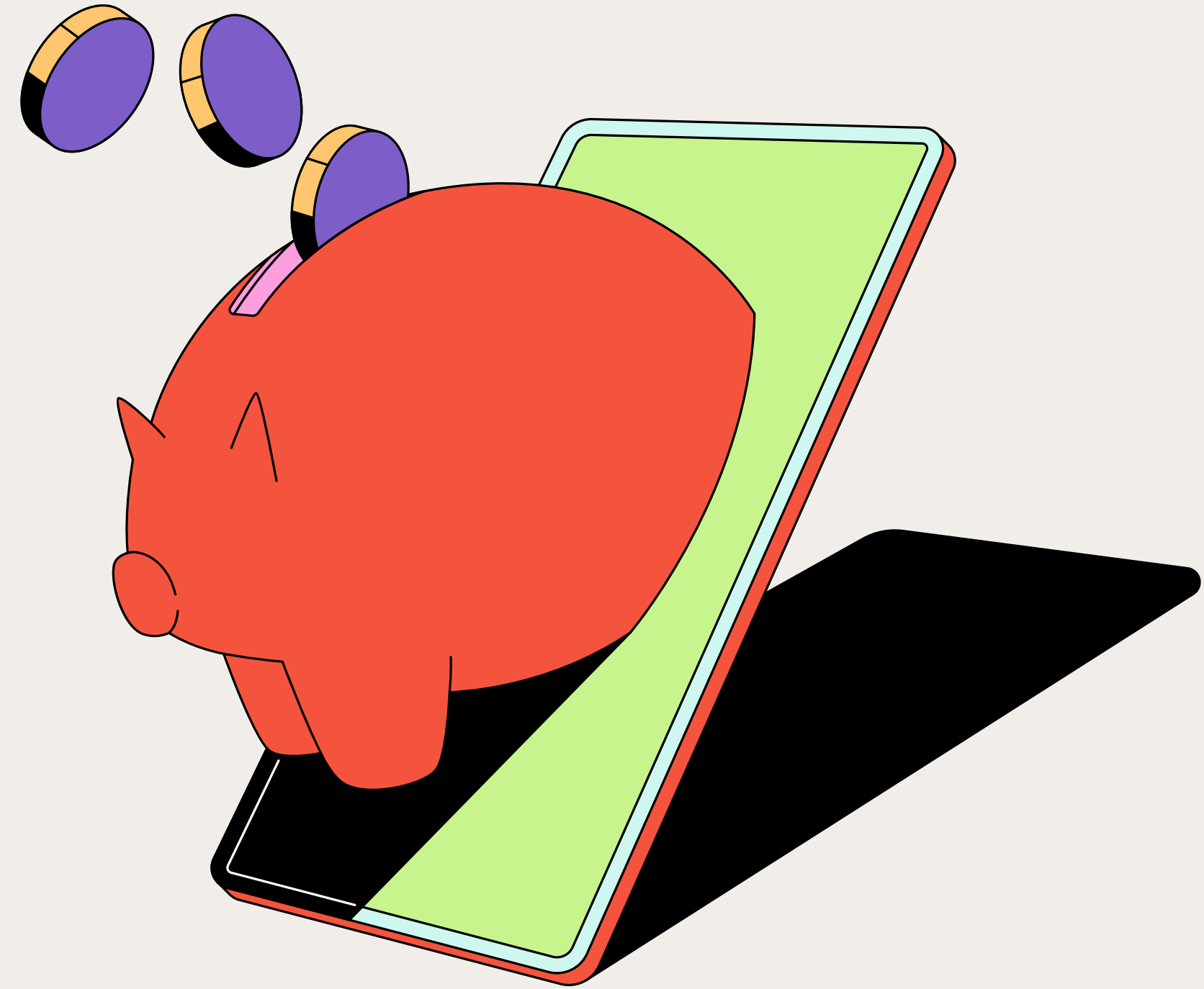


Elaboración de
gráficos en Python

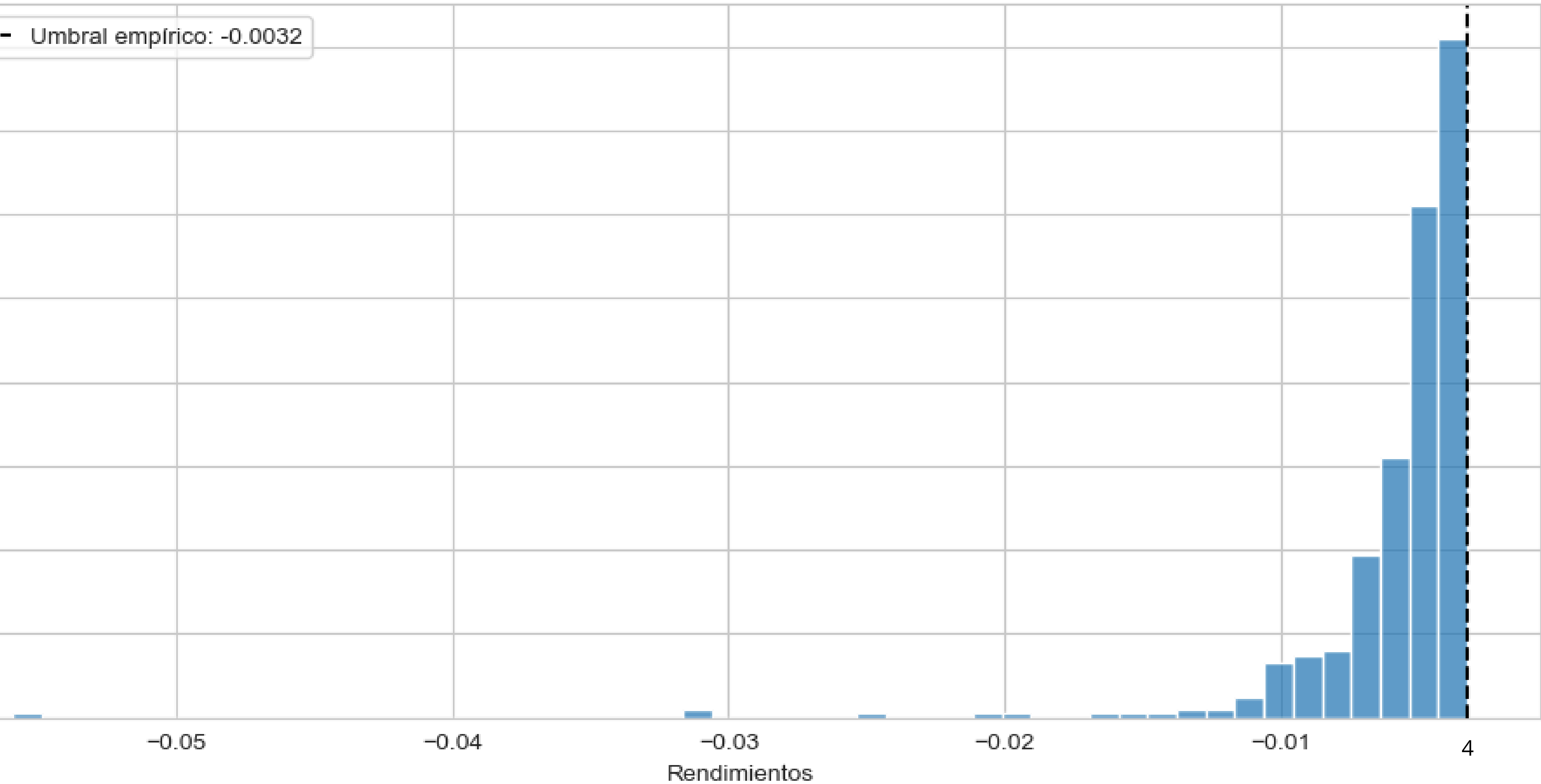


Ampliación del
marco teórico y
documentación de
métodos de CVaR

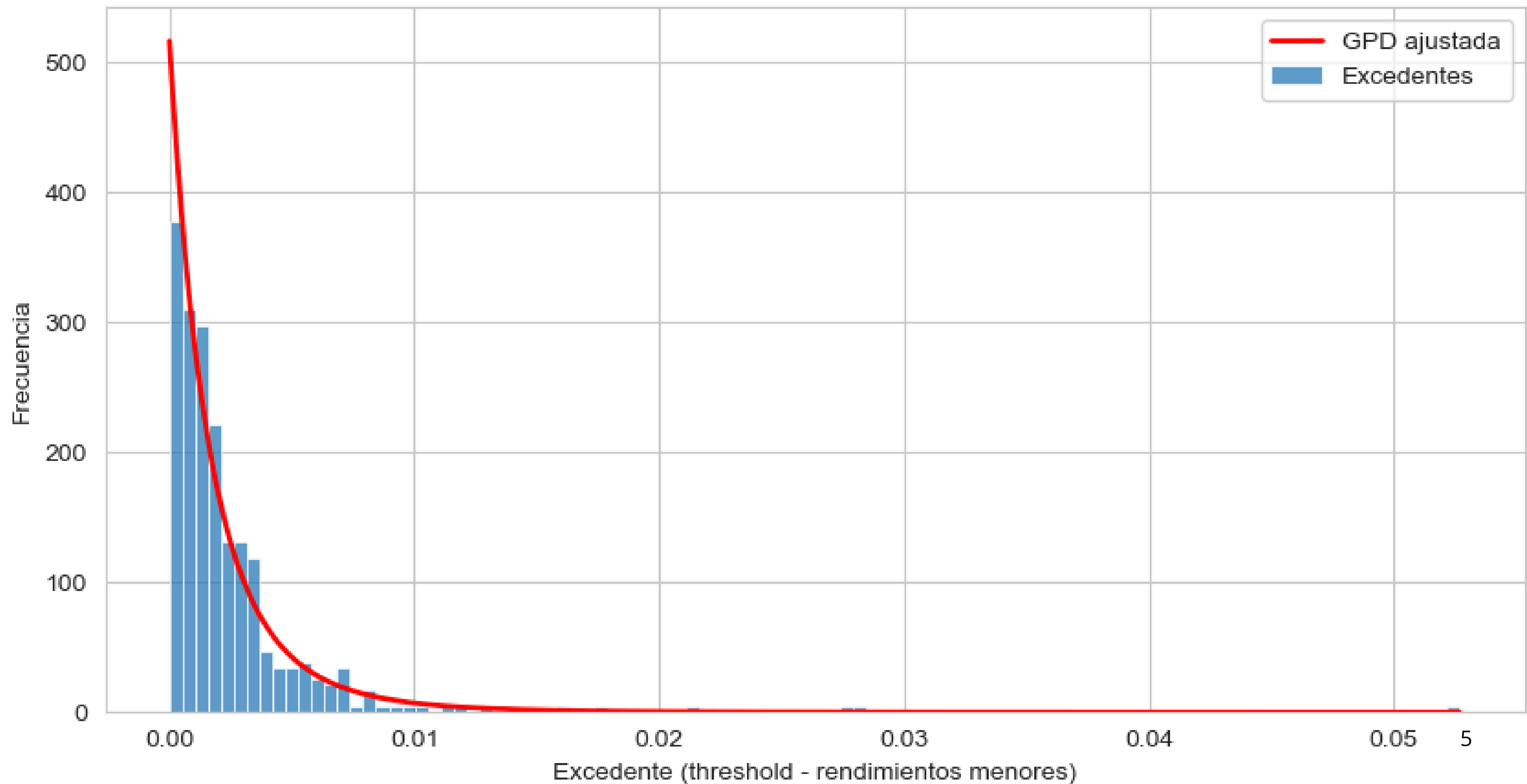
Conceptos



Cola izquierda de ['BND'] (q = 0.1)



Ajuste GPD a excedentes de BND



¿Cómo se interpreta el CVaR en este método?

- **Suponga que se quiere encontrar el CVaR al 0.05. Y modelamos los excedentes de la cola con umbral $q = 10\%$.**

Entonces, el CVaR estima el peor $0.05/0.1 = 50\%$ de los peores casos de la cola habiendo traspasado el umbral.

Para este ejemplo, usando los datos anteriores:

- **CVaR = -0.007**



**Gracias por su
atención**