

Análisis de riesgo en la inversión financiera

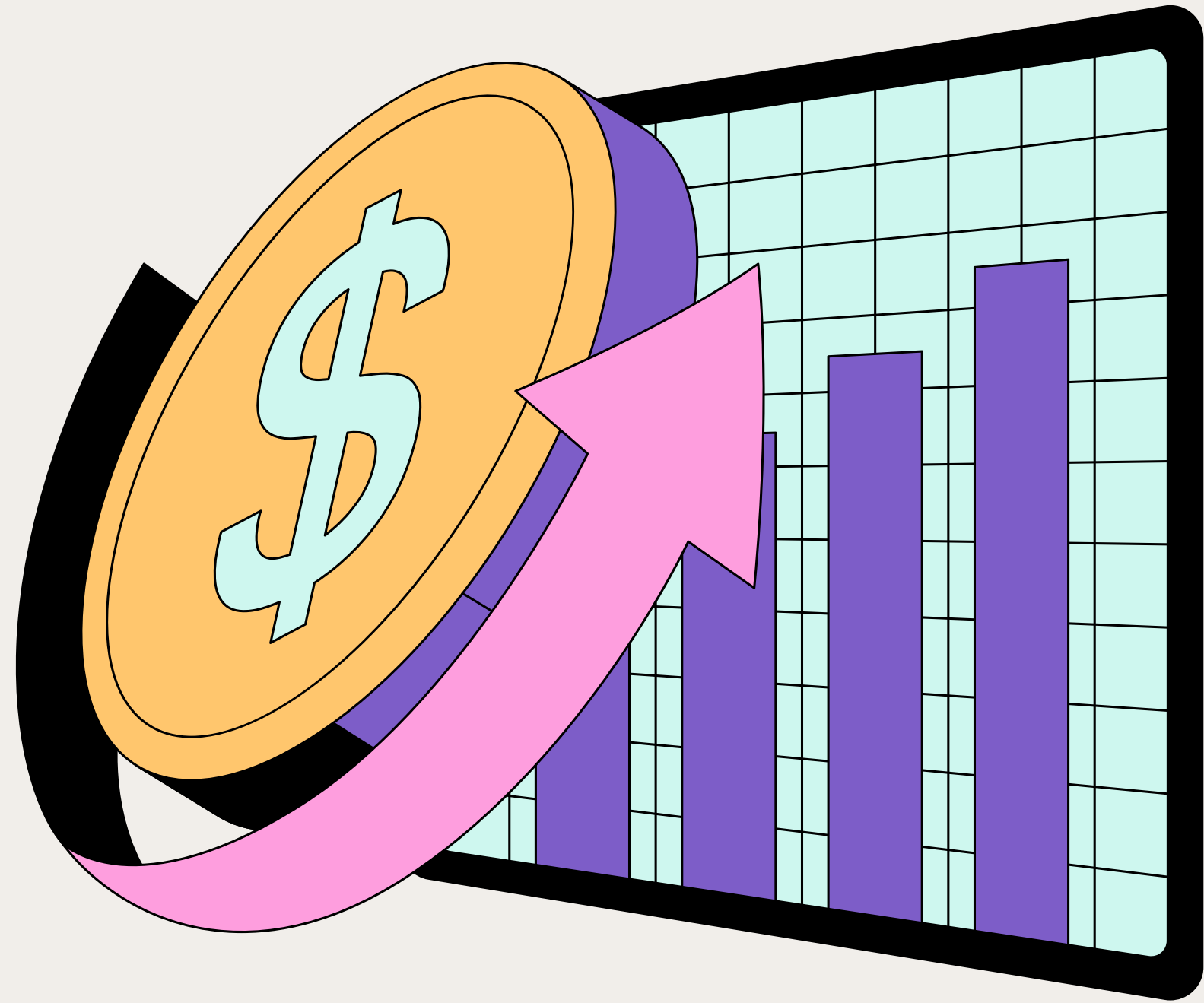
Integrantes

Jeremy Flores Bonilla

Dominick Rodríguez Trejos

Cristhofer Urrutia Cascante

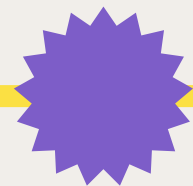
Gabriel Valverde Guzmán



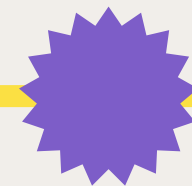
Tareas del Sprint #6



Estimar la
probabilidad de
que una
observación este
por debajo del
umbral



Aplicación del
modelo en un caso
de estudio



Análisis e
interpretación de
los resultados
obtenidos

Caso de estudio: SPY y QQQ



SPDR S&P 500
(**SPY**)

Replica el índice Standard and Poor's 500 (S&P 500)

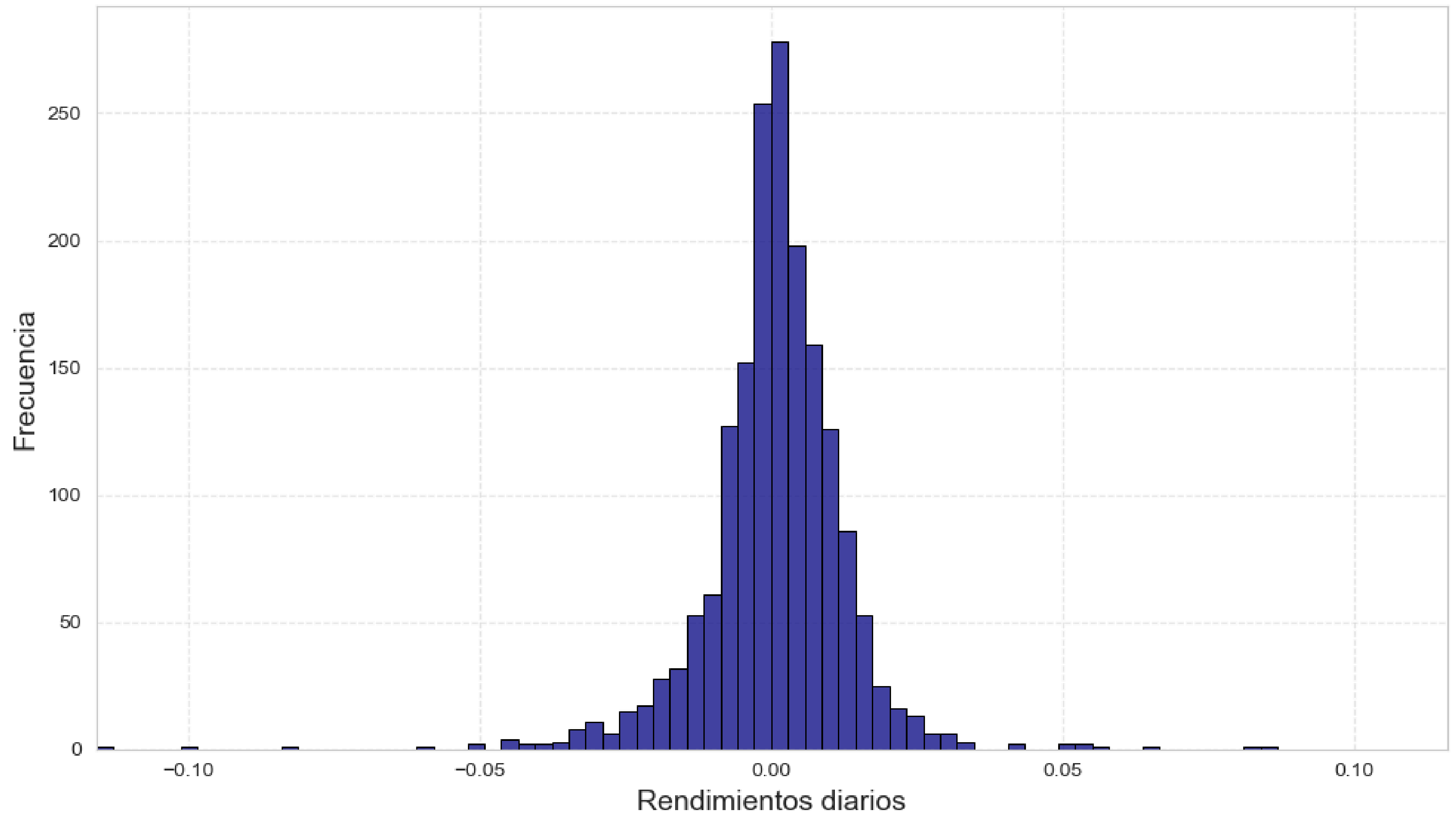
Invesco (QQQ)

Replica el índice Nasdaq-100

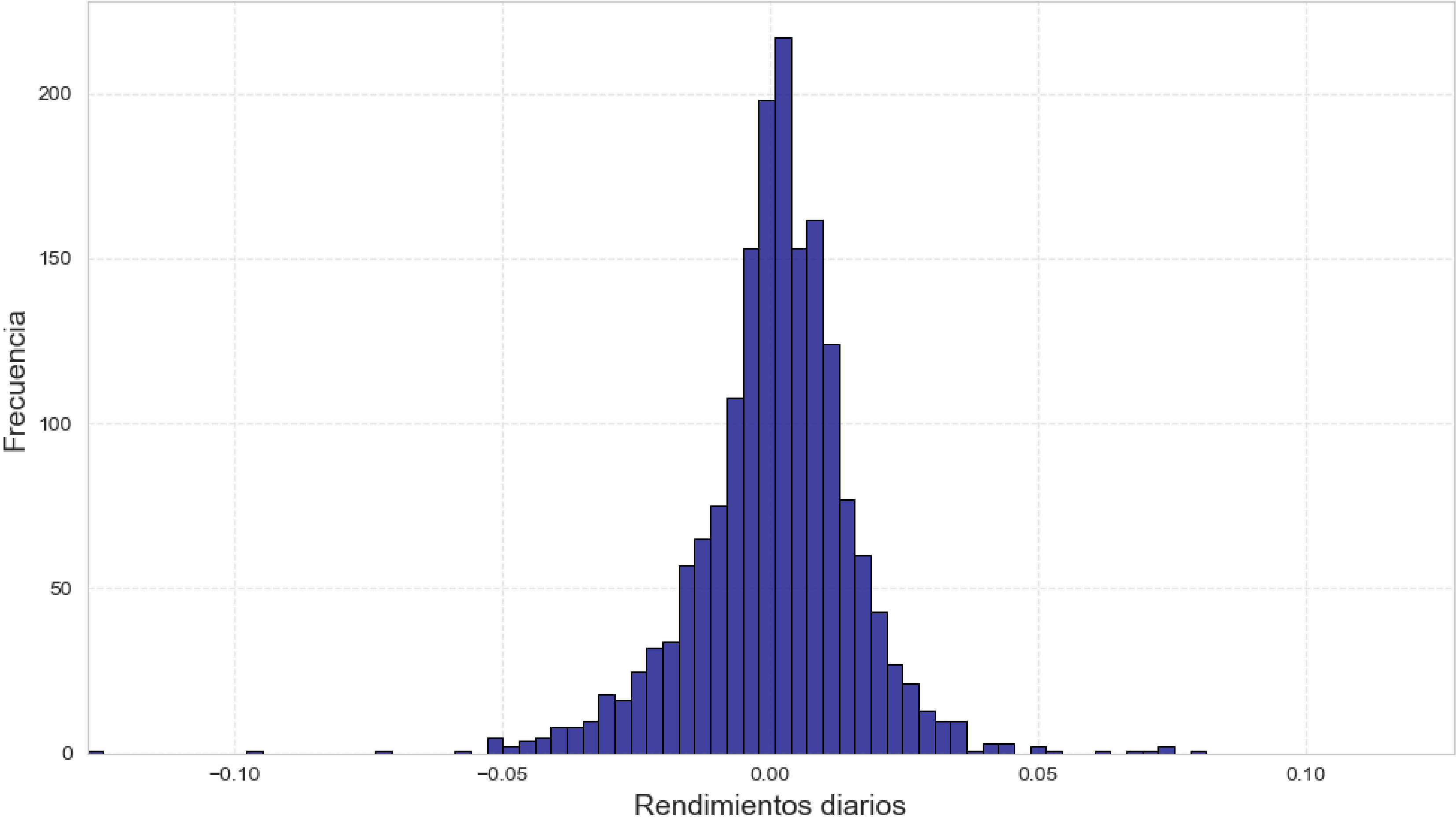


Resultados obtenidos

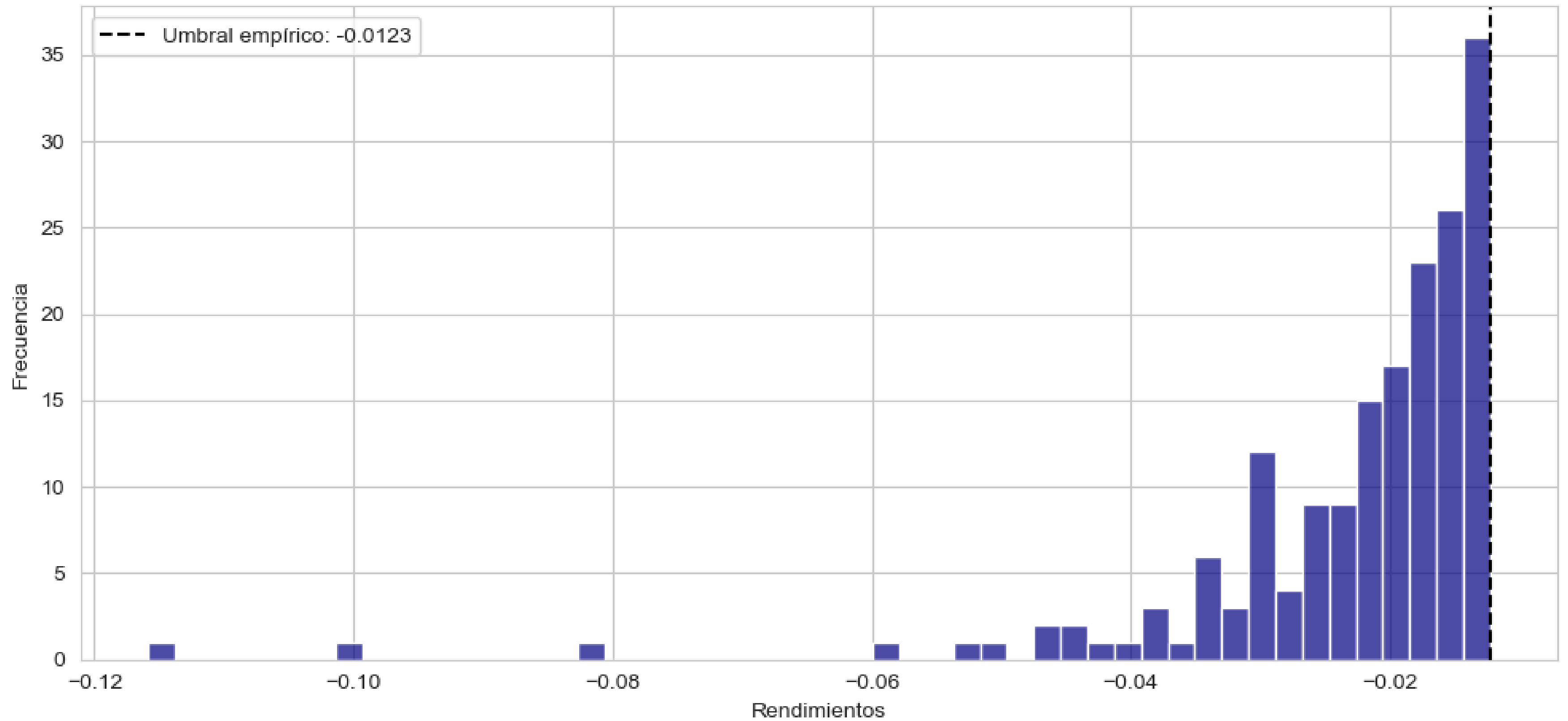
Rendimientos diarios de SPY



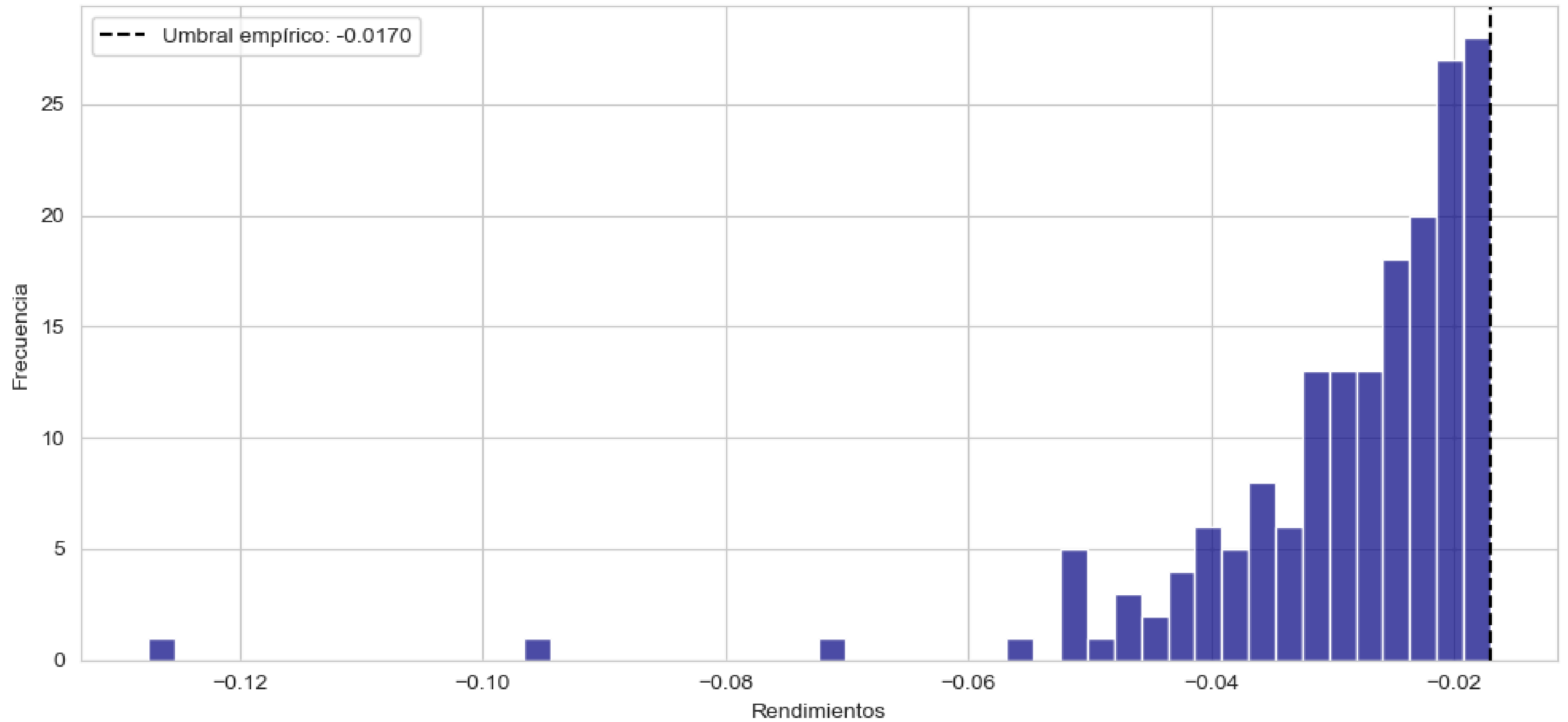
Rendimientos diarios de QQQ



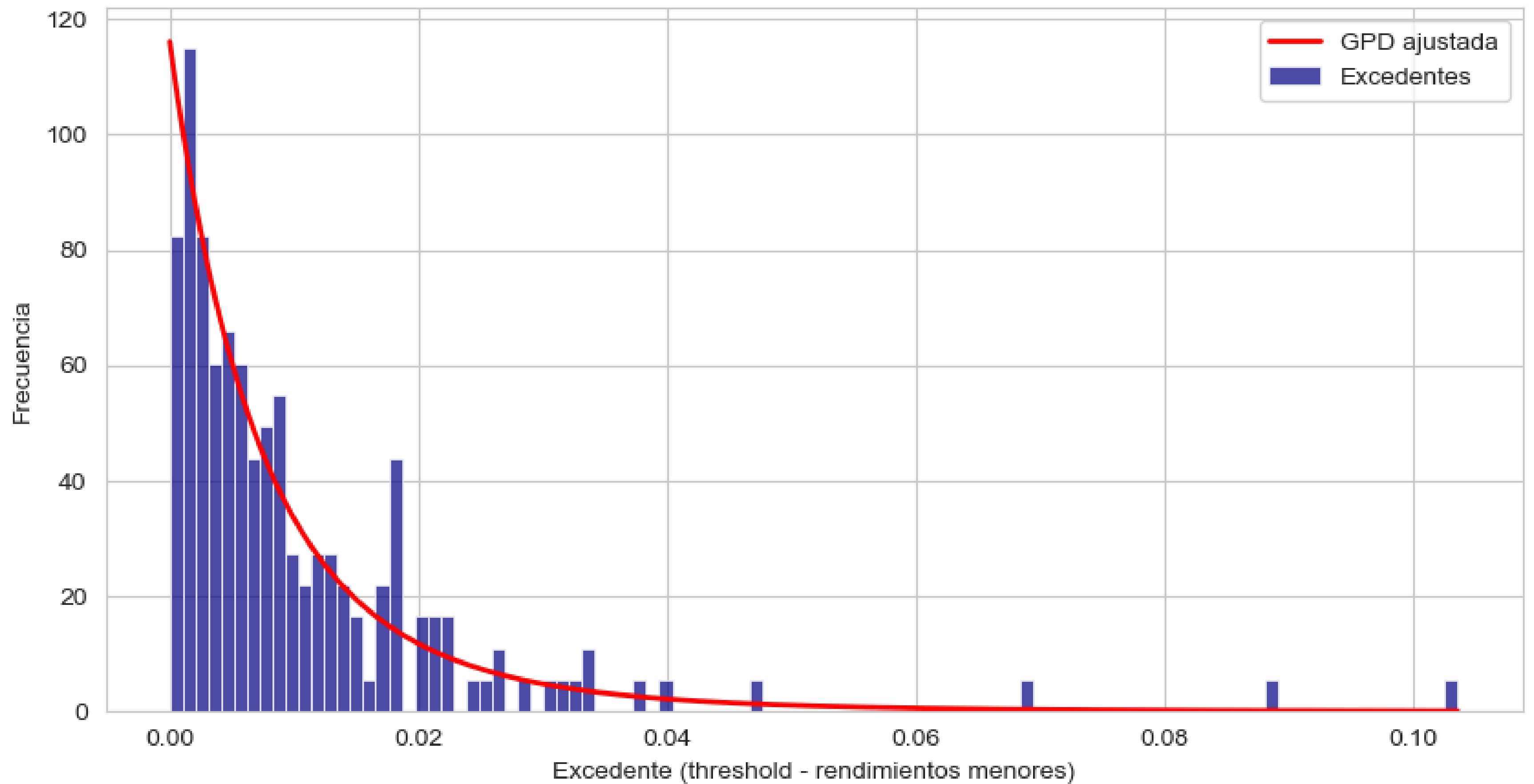
Cola izquierda de SPY (q = 0.1)



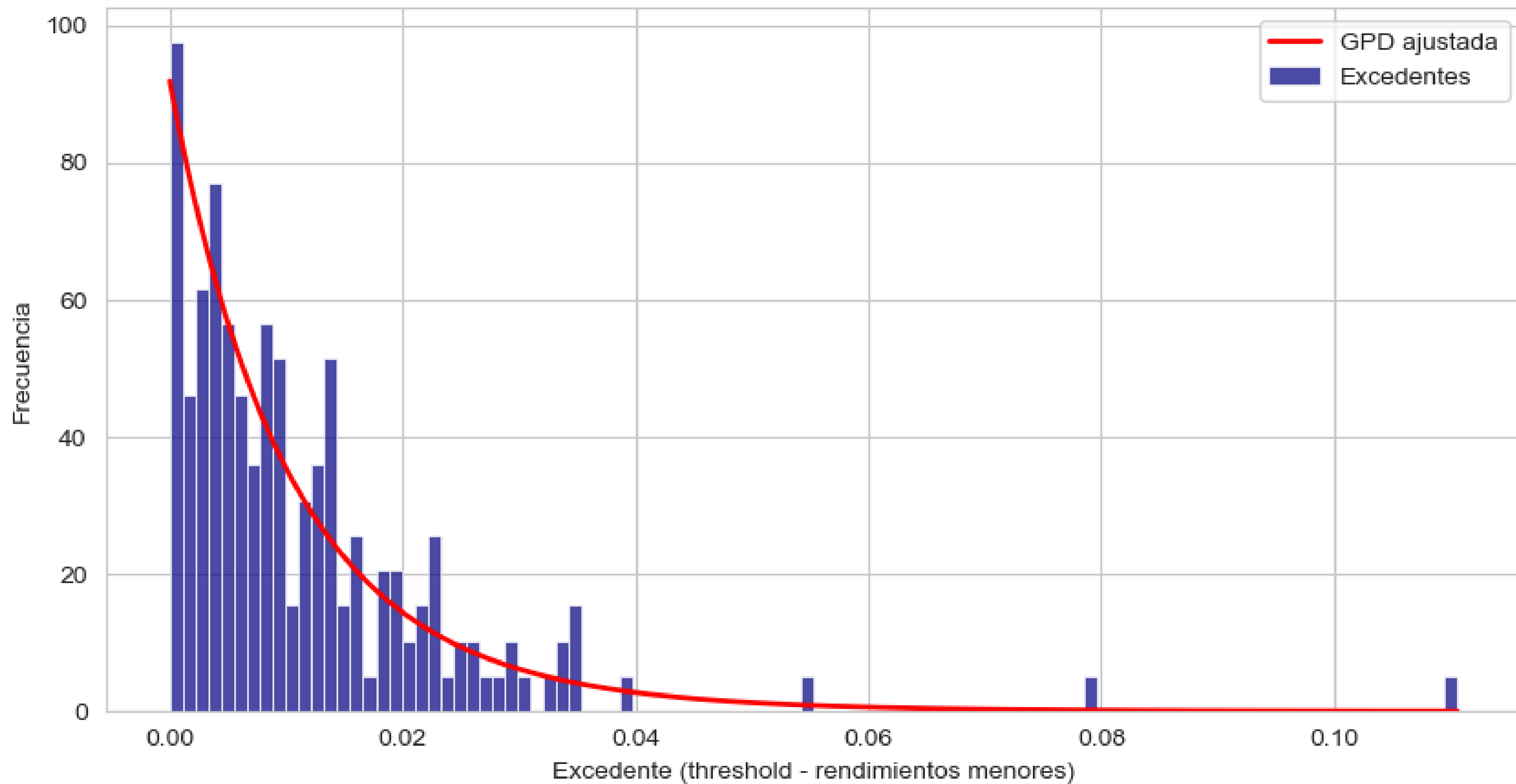
Cola izquierda de QQQ (q = 0.1)



Ajuste GPD a excedentes de SPY

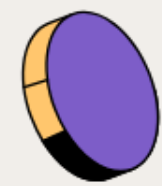


Ajuste GPD a excedentes de QQQ



Medida	SPY	QQQ
Cuantil empírico al 10 %	−0,0123	−0,0170
ξ	0,1815	0,068
σ	0,0086	0,0108
ρ -valor	0,99	0,724
$VaR_{1-95\%}$	−0,018	−0,0248
$CVaR_{1-95\%}$	−0,03	−0,037

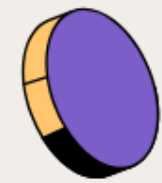
Interpretación de los resultados



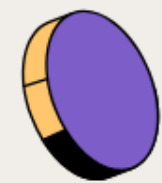
La cola inferior de SPY es más pesada en comparación a la de QQQ



QQQ experimenta pérdidas más grandes en comparación a SPY



Invertir en QQQ: más riesgoso en magnitud de pérdidas extremas.



Invertir en SPY: más riesgoso en frecuencia de eventos extremos.

**Gracias por su
atención**

