

Estimado comité editorial:

Por este medio, les solicito respetuosamente considerar el siguiente manuscrito en la Revista Serengueti de la Escuela de Estadística (Universidad de Costa Rica). Además, en CC se está depositando una copia a Adlyceum.

El presente estudio se titula Análisis de riesgo financiero en inversiones por medio de las medidas de pérdida en casos extremos: VaR y CVaR. Este estudio explora cómo los rendimientos financieros presentan eventos extremos que pueden generar pérdidas significativas al inversionista. En particular, responde a la pregunta de investigación sobre cómo modelar y cuantificar el riesgo extremo mediante teoría de valores extremos.

Para resolver estas preguntas se ejecutaron análisis basados en la metodología POT, ajustando una distribución Generalizada de Pareto (GPD) a los excedentes y estimando las medidas VaR y CVaR. Para este caso encontramos que la cola de pérdidas extremas es significativamente más severa en un ETF que en otro. Esto es relevante, ya que encontramos que el enfoque POT permite caracterizar adecuadamente el riesgo extremo.

Consideramos que este trabajo es valioso para los lectores de la Revista Serengueti, porque provee una aplicación estadística rigurosa y clara de la teoría de valores extremos al análisis de riesgo financiero, un campo donde este tipo de modelos es cada vez más necesario. Además, esto es importante para el campo de la estadística aplicada, pues demuestra el uso práctico de métodos avanzados para evaluar riesgos reales en contextos financieros.

Para efectos administrativos, el estudiante Dominick Rodríguez Trejos (dominick.rodriguez@ucr.ac.cr) es el autor para toda correspondencia. Confirmamos que este manuscrito no ha sido publicado en otro lugar y no está siendo considerado por otra revista. Todos los autores han aprobado el manuscrito y están de acuerdo con su presentación a la Revista Serengueti.

Le saluda cordialmente

Dominick Rodríguez Trejos