

SIMULACION DE MONTECARLO MEDIANTE EL CRYSTAL BALL PARA EL ANALISIS DEL VAR DE UN PORTAFOLIO DEL SECTOR FINANCIERO

Mediante la simulación de montecarlo la cual genera cierta cantidad de números aleatorios, se estudia el riesgo de mercado de las entidades bancarias colombianas. En esta investigación se aplican herramientas como el Crystal Ball que permite pronosticar horizontes de pérdida y/o ganancia diaria con niveles del 99% y 95% de confianza, mediante la simulación de 1.000 números aleatorios, que maximizan el riesgo esperado de tres de las mejores entidades bancarias que cotizan en la Bolsa de Valores de Colombia en los años 2.005, 2.006 y 2.007. Para una mejor evaluación de estas entidades se aplican teorías de evaluación como la dominancia y la teoría de Carteras propuesta por Harry Markowitz.

MONTECAR SIMULATION IT BY MEANS OF CRYSTAL BALL FOR THE ANALYSIS OF THE VAR OF A PORTAFOLIO OF THE FINANCIAL SECTOR

By means of the simulation of montecar it which generates certain amount of random numbers, the risk of market of the Colombian banking organizations studies. In this investigation tools like the Crystal Ball who allows to foretell horizons of loss and/or daily gain with levels of 99% and 95% of confidence are applied, by means of the simulation of 1,000 random numbers, that maximize the waited for risk of three of the best banking organizations than they quote in stock-market of Values of Colombia in years 2,005, 2,006 and 2.007. For one better evaluation of these organizations the dominancia and the propose theory of Portfolios by Harry Markowitz are applied to theories of evaluation like.