



Risk Assistant

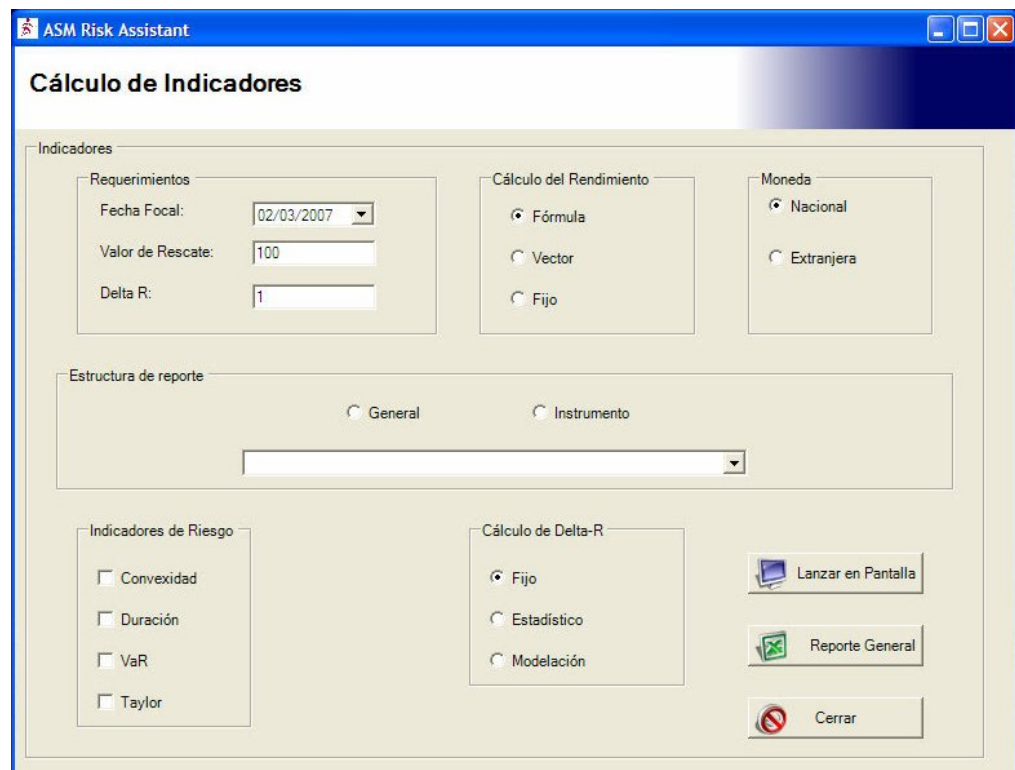
Risk Management Application

Versión Riesgo de Mercado

El Risk Assistant® es la verdadera primera herramienta tecnológica que combina el acceso depurado a la información agregada y detallada de las áreas del negocio, con los procesos estadísticos y econométricos más avanzados, para producir indicadores, modelos analíticos, simulaciones y demás funciones relacionadas con la medición y gestión de los fenómenos de riesgo.

El Risk Assistant® Riesgo de Mercado considera las fluctuaciones de las principales variables de mercado y sus efectos sobre la composición de los activos y pasivos del cliente, y consecuentemente sus efectos sobre la utilidad de la institución. El modelo considera la exposición a Riesgo de Tasas de Interés, Riesgo de Tipo de Cambio, Riesgo de Liquidez. .

“Conocimiento integral de riesgo: lo que no se puede medir, no se puede controlar”



The screenshot shows the 'ASM Risk Assistant' application window with the title 'Cálculo de Indicadores'. The interface includes several sections:

- Indicadores:**
 - Requerimientos:** Fecha Focal (02/03/2007), Valor de Rescate (100), Delta R (1).
 - Cálculo del Rendimiento:** Radio buttons for Fórmula (selected), Vector, and Fijo.
 - Moneda:** Radio buttons for Nacional (selected) and Extranjera.
- Estructura de reporte:** Radio buttons for General (selected) and Instrumento, with a dropdown menu below.
- Indicadores de Riesgo:** Checkboxes for Convexidad, Duración, VaR, and Taylor.
- Cálculo de Delta-R:** Radio buttons for Fijo (selected), Estadístico, and Modelación.
- Buttons:** Lanzar en Pantalla, Reporte General, and Cerrar.

Componentes

- Cálculo del Valor en Riesgo de Tasas de Interés.
- Cálculo individual de los componentes de Valor en Riesgo de Tasas de Interés:
 - Fluctuación Esperada
 - Variación típica de T_i
 - Duración Activo
 - Duración Pasivo
 - Gap Anual
 - Duración Modificada
 - % Valor en Riesgo
- Cálculo del Valor en Riesgo de Tipo de Cambio
- Cálculo individual de los componente del Valor en Riesgo de Cambio:
 - Fluctuación esperada en Tasa de Cambio
 - Tiempo para deshacer la posición
 - Posición Neta en Moneda Extranjera
- Análisis back testing
- Análisis estrés testing:
 - Según requerimiento del regulador.
 - Cuatro estructuras alternativas de tipos de cambio y tasas de interés de referencia.
- Indicadores de volatilidad sobre el inventario de instrumentos, como rendimiento, por formula, vector y fijo.
- Cálculo del Delta del rendimiento por modelación, estadístico y por valor. .
- Cálculo de Duración, Duración Relativa, Duración Modificada .
- Cálculo de Taylor +, Taylor - .
- Cálculo del VAR +, Var - .
- Cálculo de la Convexidad, Convexidad Relativa, Convexidad Moneda .
- Simulación Montecarlo.


 Risk Assistant
 Risk Management Application

Más que un sistema obtenga una solución de riesgo a la medida de sus necesidades

