



RISK-LAB ▶

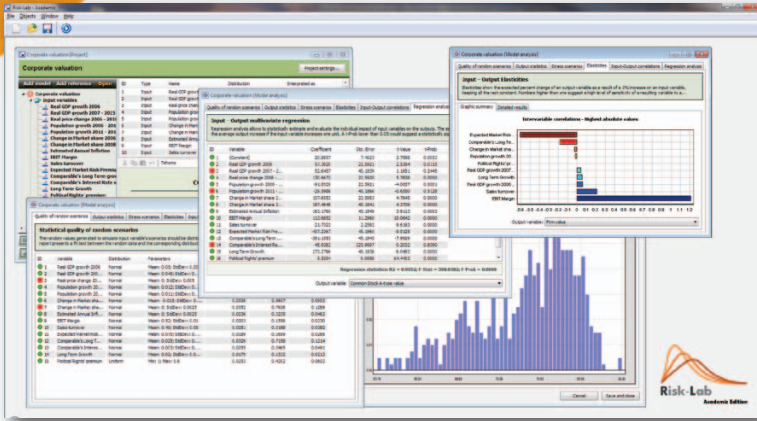
Análisis de riesgo de modelos empresariales

Operaciones | Finanzas | Producción | Ventas | Recursos Humanos | Valorización

Risk

► Un entorno integrado para el análisis de riesgos

La medición y control de riesgos se han convertido en tareas indispensables en toda organización moderna. **Risk-Lab** ofrece a los analistas empresariales un entorno integrado en el que pueden diseñar, calibrar, ejecutar, examinar y reportar los resultados de análisis de riesgos tomando como base cualquier modelo desarrollado en MS Excel®.

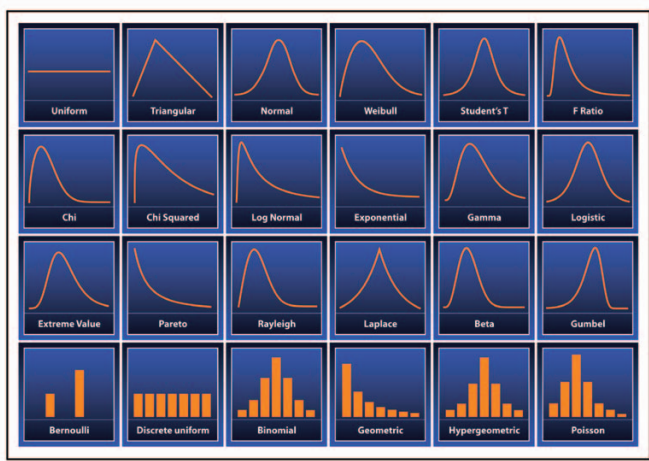


Risk-Lab es una aplicación autónoma que permite aplicar una amplia gama de herramientas de análisis de riesgo, tales como:

- Simulaciones Monte-Carlo multivariantes
- Análisis de elasticidad entre variables
- Regresiones multivariantes entre supuestos y resultados.
- Optimización de ajuste a distribuciones estadísticas
- Creación de histogramas e intervalos de confianza
- Formación de cópulas multivariantes

► Modelado de supuestos

Risk-Lab contiene una extensa librería de distribuciones de probabilidad que hacen posible modelar convenientemente los márgenes de fluctuación y niveles de incertidumbre de las variables de un modelo empresarial. El usuario puede configurar los supuestos manualmente o dejar que el sistema lo haga de modo automático.

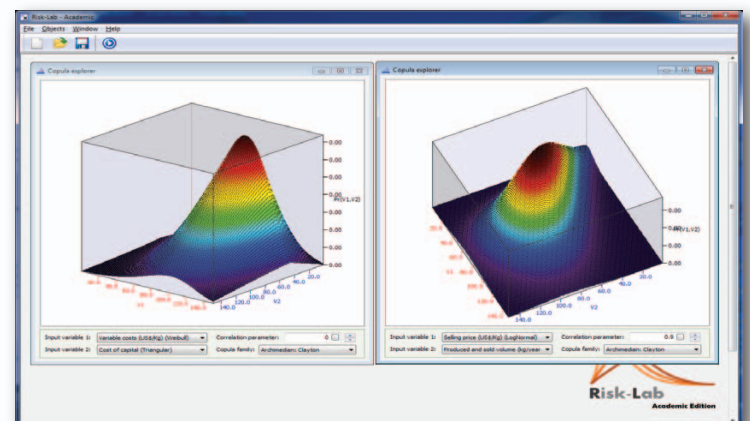
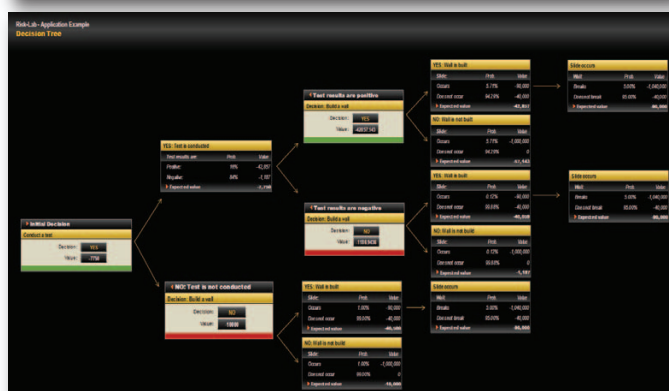


“**Risk-Lab** nos permite realizar el análisis de riesgo de nuestras inversiones en tiempo récord.”

Banco de la Nación, Perú

► Experiencia visual

La presentación de resultados en **Risk-Lab** ha sido configurada para permitir una rápida interpretación y selección de indicadores para la toma de decisiones. Adicionalmente, el sistema dispone de herramientas interactivas especialmente diseñadas para facilitar la explicación de las técnicas del análisis de simulación a público no-experto.



Herramientas para la toma de decisiones

Risk-Lab brinda una respuesta objetiva a preguntas clave del análisis de riesgo de modelos empresariales, tales como: ¿Cuáles son las variables inciertas que más pueden afectar los resultados? ¿Dentro de qué rango pueden fluctuar los resultados, considerando escenarios de estrés imprevistos? O ¿Cuál es la probabilidad de que los resultados se encuentren por debajo de un cierto umbral aceptable para la empresa?

Mediante el uso de simulaciones Monte-Carlo sobre miles de escenarios plausibles, **Risk-Lab** añade una capa de análisis de gran valor sobre cualquier modelo creado en hojas de cálculo de MS Excel®, el paquete estándar más empleado por los analistas profesionales.

El uso de **Risk-Lab** complementa cualquier estudio cuantitativo, evita destinar horas de trabajo a simular escenarios alternos y reduce notablemente el riesgo operacional y la subjetividad que supone la experimentación manual con modelos complejos.

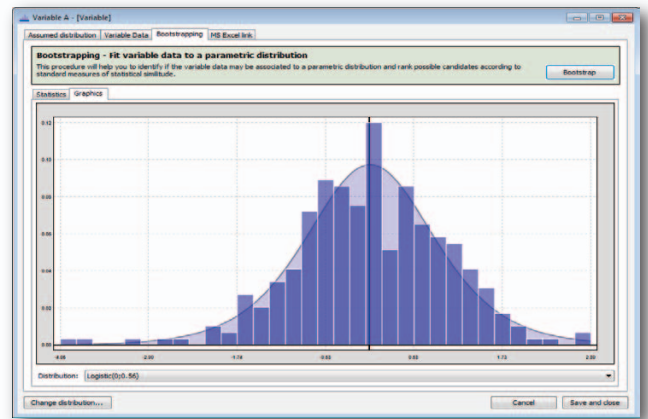


Opciones para usuarios avanzados

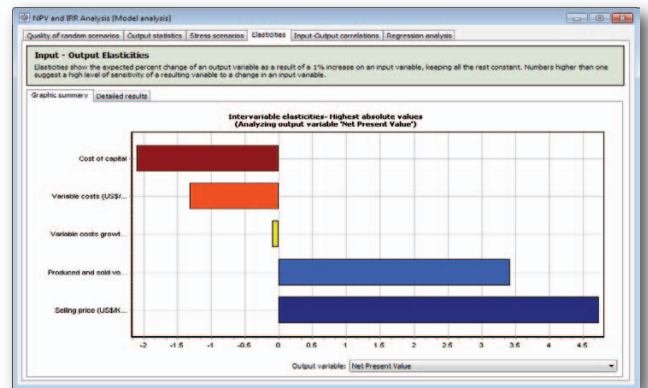
Si bien el sistema es capaz de operar con un alto grado de automatización, **Risk-Lab** ofrece a los usuarios más avanzados la posibilidad de configurar el análisis con sumo detalle y extraer resultados parciales que pueden luego utilizarse se como insumos de otros cálculos.

En este sentido, el analista puede elegir entre distintos tipos de cópulas elípticas y arquimedianas para realizar las simulaciones, fijar las semillas de simulación de modo que puedan replicarse fácilmente los resultados obtenidos en análisis previos, simular celdas que incluyen fórmulas, variar los grados de correlación entre variables, recalibrar manualmente los parámetros de la distribución de cada supuesto, etc.

Contáctenos hoy mismo para solicitar una demostración a mail@risk-o.com



Configuración de una variable del modelo como distribución de probabilidad

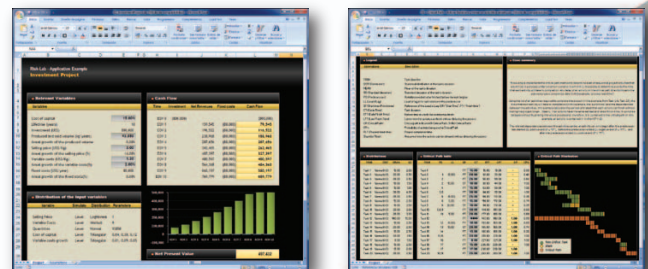


Elasticidades entre variables de decisión y resultados del modelo

| Variable | Coefficient | Std. Error | t-Value | t-Prob |
|--------------------------------------|-------------|------------|---------|--------|
| 1 (Constant) | 20.8857 | 7.4623 | 2.7988 | 0.0053 |
| 2 Real GDP growth 2006 | 57.3020 | 22.5921 | 2.5364 | 0.0115 |
| 3 Real GDP growth 2007 - 2006 | 52.6487 | 45.1839 | 1.1651 | 0.2445 |
| 4 Real price change 2006 - 2005 | 130.6672 | 22.5920 | 5.7838 | 0.0000 |
| 5 Population growth 2006 | 21.8529 | 22.5921 | -0.9657 | 0.0001 |
| 6 Population growth 2011 - 2006 | -24.5886 | 45.1866 | -0.5350 | 0.5128 |
| 7 Change in Market share 2006 | 107.6553 | 22.5923 | 4.7645 | 0.0000 |
| 8 Change in Market share 2007 - 2006 | 197.4648 | 45.1841 | 4.3709 | 0.0000 |
| 9 Estimated Annual Inflation | 163.1760 | 45.1849 | 3.6115 | 0.0003 |
| 10 EBIT Margin | 113.6852 | 11.2960 | 10.0642 | 0.0000 |
| 11 Sales turnover | 21.7323 | 2.2592 | 9.6193 | 0.0000 |
| 12 Expected Market Risk Premium | -07.2267 | 45.1860 | -0.1625 | 0.0000 |
| 13 Comparable's long term | -61.1553 | 45.1841 | -1.3524 | 0.0000 |
| 14 Comparable's Interest Rate | 45.9282 | 225.9197 | 0.2032 | 0.0390 |
| 15 Long Term Growth | 273.2796 | 45.1838 | 6.0482 | 0.0000 |
| 16 Political Rights premium | 5.5294 | 0.0858 | 64.4403 | 0.0000 |

Regression statistics: R2 = 0.9052; F-Stat = 306.0382; F-Prob = 0.0000

Regresión multivariante entre resultados y supuestos de modelo



Aplicación de Risk-Lab a valoración de inversiones y análisis de rutas críticas

Lab



www.risk-o.com | mail@risk-o.com | +1.800.573.7475

