



8. Implantación del VaR, vía Montecarlo (Valor en Riesgo).
  - d. Potencialidades
  - e. Debilidades del VaR como medida de Riesgo.

### **III. Bibliografía recomendada**

Jorion. **Valor en Riesgo**. LIMUSA.

Diz E. **Introducción a la Teoría de Riesgo**. GLOBAL EDICIONES.

Holton. **Value at Risk**. ACADEMIC PRESS

Shubert. **Finance and Statistic an Introducción**. SPRINGER VERLAG