



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION

Especialista en Medición de Riesgos de Mercado y Crédito





Elige aprender en la escuela  
**líder en formación online**

# ÍNDICE

1 | Somos  
Euroinnova

2 | Rankings

3 | Alianzas y  
acreditaciones

4 | By EDUCA  
EDTECH  
Group

5 | Metodología  
LXP

6 | Razones por  
las que  
elegir  
Euroinnova

7 | Financiación  
y Becas

8 | Métodos de  
pago

9 | Programa  
Formativo

10 | Temario

11 | Contacto

## SOMOS EUROINNOVA

---

**Euroinnova International Online Education** inicia su actividad hace más de 20 años. Con la premisa de revolucionar el sector de la educación online, esta escuela de formación crece con el objetivo de dar la oportunidad a sus estudiantes de experimentar un crecimiento personal y profesional con formación eminentemente práctica.

Nuestra visión es ser **una institución educativa online reconocida en territorio nacional e internacional** por ofrecer una educación competente y acorde con la realidad profesional en busca del reciclaje profesional. Abogamos por el aprendizaje significativo para la vida real como pilar de nuestra metodología, estrategia que pretende que los nuevos conocimientos se incorporen de forma sustantiva en la estructura cognitiva de los estudiantes.

Más de

**19**

años de  
experiencia

Más de

**300k**

estudiantes  
formados

Hasta un

**98%**

tasa  
empleabilidad

Hasta un

**100%**

de financiación

Hasta un

**50%**

de los estudiantes  
repite

Hasta un

**25%**

de estudiantes  
internacionales

[Ver en la web](#)



**EUROINNOVA**  
INTERNACIONAL ONLINE EDUCATION



Desde donde quieras y como quieras,  
**Elige Euroinnova**



**QS, sello de excelencia académica**  
Euroinnova: 5 estrellas en educación online

## RANKINGS DE EUROINNOVA

---

Euroinnova International Online Education ha conseguido el reconocimiento de diferentes rankings a nivel nacional e internacional, gracias por su apuesta de **democratizar la educación** y apostar por la innovación educativa para **lograr la excelencia**.

Para la elaboración de estos rankings, se emplean **indicadores** como la reputación online y offline, la calidad de la institución, la responsabilidad social, la innovación educativa o el perfil de los profesionales.



[Ver en la web](#)



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION

## ALIANZAS Y ACREDITACIONES



Ver en la web



EUROINNOVA  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION

## BY EDUCA EDTECH

---

Euroinnova es una marca avalada por **EDUCA EDTECH Group**, que está compuesto por un conjunto de experimentadas y reconocidas **instituciones educativas de formación online**. Todas las entidades que lo forman comparten la misión de **democratizar el acceso a la educación** y apuestan por la transferencia de conocimiento, por el desarrollo tecnológico y por la investigación



### ONLINE EDUCATION

---



Ver en la web

# METODOLOGÍA LXP

---

La metodología **EDUCA LXP** permite una experiencia mejorada de aprendizaje integrando la AI en los procesos de e-learning, a través de modelos predictivos altamente personalizados, derivados del estudio de necesidades detectadas en la interacción del alumnado con sus entornos virtuales.

EDUCA LXP es fruto de la **Transferencia de Resultados de Investigación** de varios proyectos multidisciplinares de I+D+i, con participación de distintas Universidades Internacionales que apuestan por la transferencia de conocimientos, desarrollo tecnológico e investigación.



## 1. Flexibilidad

Aprendizaje 100% online y flexible, que permite al alumnado estudiar donde, cuando y como quiera.



## 2. Accesibilidad

Cercanía y comprensión. Democratizando el acceso a la educación trabajando para que todas las personas tengan la oportunidad de seguir formándose.



## 3. Personalización

Itinerarios formativos individualizados y adaptados a las necesidades de cada estudiante.



## 4. Acompañamiento / Seguimiento docente

Orientación académica por parte de un equipo docente especialista en su área de conocimiento, que aboga por la calidad educativa adaptando los procesos a las necesidades del mercado laboral.



## 5. Innovación

Desarrollos tecnológicos en permanente evolución impulsados por la AI mediante Learning Experience Platform.



## 6. Excelencia educativa

Enfoque didáctico orientado al trabajo por competencias, que favorece un aprendizaje práctico y significativo, garantizando el desarrollo profesional.



Programas  
**PROPIOS**  
**UNIVERSITARIOS**  
**OFICIALES**

## RAZONES POR LAS QUE ELEGIR EUROINNOVA

### 1. Nuestra Experiencia

- ✓ Más de **18 años de experiencia.**
- ✓ Más de **300.000 alumnos** ya se han formado en nuestras aulas virtuales
- ✓ Alumnos de los 5 continentes.
- ✓ **25%** de alumnos internacionales.
- ✓ **97%** de satisfacción
- ✓ **100% lo recomiendan.**
- ✓ Más de la mitad ha vuelto a estudiar en Euroinnova.

### 2. Nuestro Equipo

En la actualidad, Euroinnova cuenta con un equipo humano formado por más **400 profesionales**. Nuestro personal se encuentra sólidamente enmarcado en una estructura que facilita la mayor calidad en la atención al alumnado.

### 3. Nuestra Metodología



#### 100% ONLINE

Estudia cuando y desde donde quieras. Accede al campus virtual desde cualquier dispositivo.



#### APRENDIZAJE

Pretendemos que los nuevos conocimientos se incorporen de forma sustantiva en la estructura cognitiva



#### EQUIPO DOCENTE

Euroinnova cuenta con un equipo de profesionales que harán de tu estudio una experiencia de alta calidad educativa.



#### NO ESTARÁS SOLO

Acompañamiento por parte del equipo de tutorización durante toda tu experiencia como estudiante

## 4. Calidad AENOR

- ✓ Somos Agencia de Colaboración N°99000000169 autorizada por el Ministerio de Empleo y Seguridad Social.
- ✓ Se llevan a cabo auditorías externas anuales que garantizan la máxima calidad AENOR.
- ✓ Nuestros procesos de enseñanza están certificados por **AENOR** por la ISO 9001.



## 5. Confianza

Contamos con el sello de **Confianza Online** y colaboramos con la Universidades más prestigiosas, Administraciones Públicas y Empresas Software a nivel Nacional e Internacional.



## 6. Somos distribuidores de formación

Como parte de su infraestructura y como muestra de su constante expansión Euroinnova incluye dentro de su organización una **editorial y una imprenta digital industrial**.

## FINANCIACIÓN Y BECAS

---

Financia tu cursos o máster y disfruta de las becas disponibles. ¡Contacta con nuestro equipo experto para saber cuál se adapta más a tu perfil!

**25%** Beca  
ALUMNI

**20%** Beca  
DESEMPLEO

**15%** Beca  
EMPRENDE

**15%** Beca  
RECOMIENDA

**15%** Beca  
GRUPO

**20%** Beca  
FAMILIA  
NUMEROSA

**20%** Beca  
DIVERSIDAD  
FUNCIONAL

**20%** Beca  
PARA PROFESIONALES,  
SANITARIOS,  
COLEGIADOS/AS



[Solicitar información](#)

## MÉTODOS DE PAGO

---

Con la Garantía de:



Fracciona el pago de tu curso en cómodos plazos y sin interéres de forma segura.



Nos adaptamos a todos los métodos de pago internacionales:



y muchos mas...



[Ver en la web](#)



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION



## Descripción

---

Este curso en Medición de Riesgos de Mercado y Crédito le ofrece una formación especializada en la materia. La gestión de riesgos en los mercados financieros, entraña en última instancia la gestión de los riesgos inherentes a las actividades financieras. Básicamente, dichos riesgos son de mercado, de crédito o solvencia y operacional. En las entidades financieras necesitan profesionales que realicen el seguimiento, análisis y control de los distintos riesgos. Este curso de Medición de Riesgos de Mercado y Crédito te ofrece las competencias necesarias para el cálculo de los distintos riesgos.

## Objetivos

---

- Aprender las nociones de estadística para el cálculo de riesgos.
- Identificar los objetivos de la gestión del riesgo de mercado.
- Conocer las distintas técnicas y medidas para la medición de riesgo de mercado (VAR, Reporting, Backtesting).
- Aprender los riesgos de mercado y el cálculo de las pérdidas.

## A quién va dirigido

---

El presente Curso en Medición de Riesgos de Mercado y Crédito está dirigido a todas aquellas personas interesadas en obtener una formación en la gestión y medición de riesgos y a todos los profesionales que quieran ampliar sus conocimientos en el riesgo de mercado y de crédito.

## Para qué te prepara

---

El curso en Medición de Riesgos de Mercado y Crédito le prepara para adquirir conocimientos sobre los riesgos de mercado y de crédito, ligados al cambio de precios de los instrumentos negociados, por circunstancias de los mercados y por cambios en la situación crediticia de los emisores de los mismos.

## Salidas laborales

---

Analista comercial. Asesor y consultor comercial. Analista de mercados. Experto en gestión de riesgos. Dirección de empresas. Entidades Bancarias.

[Ver en la web](#)



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION

## TEMARIO

---

### UNIDAD DIDÁCTICA 1. ESTADÍSTICAS APLICADA A RIESGOS.

1. Consideraciones
2. Cálculo de volatilidades
  1. - Volatilidades sin factor de decaimiento
  2. - Volatilidades con factor de decaimiento
3. Cálculo de correlaciones
4. Cálculo de percentiles
5. Medidas de sensibilidad en finanzas: cálculo diferencial fundamental
  1. - Repaso de conceptos teóricos
  2. - Polinomio de Taylor y bonos: sensibilidad y convexidad
  3. - Aplicación de las derivadas: productos financieros derivados
  4. - Cobertura
  5. - Puesta en práctica: la opción digital
  6. - Técnicas de derivación numérica
6. Técnicas numéricas de valoración de derivados
  1. - Introducción
  2. - Árboles binomiales
  3. - La simulación de Montecarlo

### UNIDAD DIDÁCTICA 2. RIESGOS DE MERCADO.

1. Objetivos de la gestión del riesgo de mercado
2. Modelos de valoración de instrumentos financieros y valor de mercado (VM)
3. Medidas básicas de riesgos de mercado: sensibilidades, duración, convexidad
4. Medidas generales de riesgos de mercado
  1. - Value at risk (VAR)
  2. - Earnings at risk (ear):
5. Cálculo de VAR (ear) por simulación histórica
  1. - Premisas
  2. - Descripción
  3. - Implementación
6. Cálculo de VAR (ear) paramétrico
  1. - Premisas
  2. - Implementación metodología única (activos sin riesgo de interés)
7. Cálculo de VAR paramétrico basándose en sensibilidades
  1. - Premisas
  2. - Descripción
  3. - Implementación
8. Cálculo de VAR paramétrico: riskmetrics
  1. - Premisas
  2. - Descripción
  3. - Implementación
9. Cálculo del VAR por Montecarlo

1. - Premisas
  2. - Implementación
  3. - Características de la simulación de escenarios por Montecarlo
  4. - Series históricas y medidas estadísticas
  5. - Modelos de evolución
  6. - Generación de aleatorios
  7. - Escenarios por Montecarlo
10. Reporting
11. Backtesting
1. - Introducción
  2. - Backtesting: indicadores
  3. - Pruebas de contraste: principios generales
  4. - Pruebas de contraste: descripción técnica
  5. - Ejemplo de backtesting

### UNIDAD DIDÁCTICA 3. RIESGO DE CRÉDITO.

1. Tipos de riesgo de crédito
  1. - Riesgo de contrapartida
  2. - Riesgo emisor
  3. - Riesgo por país
  4. - Riesgo por liquidación
2. Exposición crediticia
3. Técnicas de mitigación
  1. - Neteo
  2. - Colateral
4. Grado de solvencia o 'rating' de una contraparte
5. Pérdida esperada
  1. - Probabilidad de incumplimiento (incondicional)
  2. - Matriz de transición
  3. - Severidad (o 'Recovery Rate')
6. Pérdida inesperada para una operación
  1. - Volatilidad de la distribución de pérdidas
7. Correlación de quiebra o 'default'
  1. - Factores que gobiernan el riesgo de crédito
8. Pérdida inesperada agregada. Efecto cartera.
  1. - Efectos de concentración en las carteras. Contribución marginal al riesgo total agregado.
9. Capital económico
10. La parametrización de la función beta
11. Derivación de la volatilidad de la pérdida para una operación

EDITORIAL ACADÉMICA Y TÉCNICA: Índice de libro Medición de riesgos de mercado y crédito. Autores: Roberto Knop Muszynski, Roland Ordovàs Miquel y Joan Francesc Vidal Villalón. Publicado por Delta Publicaciones

## ¿Te ha parecido interesante esta información?

Si aún tienes dudas, nuestro equipo de asesoramiento académico estará encantado de resolverlas.

Pregúntanos sobre nuestro método de formación, nuestros profesores, las becas o incluso simplemente conócenos.

### Solicita información sin compromiso

¡Matricularme ya!

¡Encuétranos aquí!

Edificio Educa Edtech

Camino de la Torrecilla N.º 30 EDIFICIO EDUCA EDTECH,  
C.P. 18.200, Maracena (Granada)

 900 831 200

 [formacion@euroinnova.com](mailto:formacion@euroinnova.com)

 [www.euroinnova.edu.es](http://www.euroinnova.edu.es)

### Horario atención al cliente

Lunes a viernes: 9:00 a 20:00h Horario España

¡Síguenos para estar al tanto de todas nuestras novedades!



Ver en la web



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION



**EUROINNOVA**  
INTERNATIONAL ONLINE EDUCATION

 By  
**EDUCA EDTECH**  
Group