



B-RACE Tools

BRACE Tools: Business Risk Advisory Control Enterprise

B-RACE Tools es una plataforma de servicios orientada a los diferentes tipos de riesgos financieros que requieren ser gestionados. Está basado en una tecnología asociativa/neural lo que permite tiempos muy cortos de implementación y accesos naturales a las diferentes fuentes de información.

B-RACE Tools está desarrollada bajo estándares internacionales y facilita el autoservicio de información y una personalización acelerada.

B-RACE Tools se compone de tres módulos base, a saber:

MK: Para agrupar las opciones de los riesgos de Precios, Cambiario y Tasas

LQ: Para agrupar las opciones de los riesgos de Liquidez

CR: Para agrupar las opciones de los riesgos de Crédito

Para todos los módulos se cuenta con simuladores para realizar los análisis de Stress Testing y Back Testing.

Riesgo de Mercado

Por medio de metodologías de simulación e indicadores, usted podrá determinar sus estados de inversiones y tomar decisiones ante los Riesgos con los cuales puede incurrir su organización.

ENGLISH ESPAÑOL PORTUGUÊS

Valor en Riesgo Precio Inversión
 Determine el Riesgo de Precios de inversión según diversas metodologías de simulación.

Valor en Riesgo Tasa de Interés
 Obtiene el informe de Riesgo de Tasa de Interés de sus inversiones ante las variables del mercado.

Valor en Riesgo Cambiario
 Analice los diferentes escenarios ante los Riesgos Cambiarios de sus inversiones.

La Simulación se realiza Basa Datos: 19 ENE 2019 12:10:00 AM

© SOLUTIONS GROUP / Riesgo de Mercado - V1.0.0

Riesgo Precio Inversión

Simulación

VaR Delta Normal		VaR Simulación Histórica	
M.D.		M.D.	
Nivel de Confianza	95.0%	Nivel de Confianza	95.0%
Monto de la Cartera	90.000.000	Monto de la Cartera	90.000.000
Var Diversificado	1.025.143,92	Var a 21 días	715.454,3
Var No Diversificado	1.626.453,92	Var No Diversificado	721.207,0
Beneficio Diversificación	601.310,01	Beneficio de Diversificación	5.752,603
Horizonte de Tiempo	1	Retorno en tiempo	0,79%
Var Relativo	1,14%		

Simulaciones

VaR Simulación MonteCarlo

Gráfico de distribución de VaR Simulación MonteCarlo.

Valor en Riesgo Precio Inversión / Director Reservados - 2015 - © Solutions Group - V1.0.0

Algunas de las opciones funcionales de B-RACE Tools son:

MK

Riesgo Precios

- Integración con Proveedor de Precios
- Cálculo de Rendimientos Mensuales
- VAR a diferentes niveles de confianza
- VAR por diferentes monedas
- VAR Condicional

Riesgo Cambiario

- Posición Neta en moneda extranjera
- VAR en diferentes metodologías
- VAR para diferentes niveles de confianza
- Patrimonio en Riesgo

Riesgo de Tasas de Interés

- VAR brecha moneda nacional y extranjera
- VAR a diferentes niveles de confianza
- Indicadores:
 - ◆ Brecha
 - ◆ Variación Máxima Esperada

Métodos de Simulación del VaR

- Histórico
- Delta Normal
- Monte Carlo

Análisis de datos

- Stress Testing
- Back Testing
- Auto-servicio de Información

LQ

Riesgo de Liquidez

- Vencimientos futuros de saldos
- Flujo de Caja Proyectado y calces de plazos
- Índices de liquidez
- Posición en Moneda Extranjera
- Impacto de variaciones de tipos de cambio y tasas
- Comparación de Flujos Netos de Interés
- Vencimientos y reajustes de las operaciones
- Valor Patrimonial y condiciones de inmunización
- VAR y Concentración de fuentes de liquidez

CR

Riesgo de Crédito

- VAR Riesgo de Crédito
- Rating de Clientes Paramétrico
- Probabilidad de incumplimiento
- Niveles de Provisiones
- Reportes de Crédito diversos
 - ◆ Distribución de Clientes
 - ◆ Pérdida esperada
 - ◆ Pérdida no esperada
 - ◆ Matrices de Transición
 - ◆ Patrón de Migración
 - ◆ Análisis de Concentración
 - ◆ RAROC
 - ◆ Análisis de Vulnerabilidad



Contáctenos

Teléfono: (506) 2280-8005

Fax: (506) 2283-2942

Email: writeus@b-solutionsgroup.com

Dirección:

Oficentro BSolutions Group
300m Sur y 150m Este de la POPS, #319.
Curridabat, San José. Costa Rica.

