

2013 의사결정 Day 6

ModelRisk와 Risk Management(위험 관리)

합리적 위험관리, Monte Carlo Simulation



ModelRisk 5

Risk Analysis

2013. 6. 28 (금)

디시전사이언스

DECISION
SCIENCE ■

www.decision.kr

유로드소프트

 유로드소프트

www.uroadsoft.com

2013 의사결정 Day 6 (ModelRisk와 위험 관리)

1. 배경 및 필요성

위험(Risk)은 '불확실한 변수의 변동성'을 의미하는 것으로써 우리에게 부정적 영향을 주 수도 있으나, 긍정적 영향을 줄 수도 있는 일종의 가치중립적인 개념입니다. 위험이 없으면 수익도 발전도 없습니다. 따라서 위험은 '회피의 대상'이 아니라 '관리의 대상'입니다. 합리적인 위험 관리를 위해서는 변수들 하나하나가 취할 값들을 범위로 정하고(통계의 분포함수 활용) 수 백, 수 천번, 또는 그 이상의 시뮬레이션을 통해 확인하는 것이 필요합니다. 이를 위해서 위험 분석 및 관리 전용 소프트웨어 ModelRisk를 활용하여, 위험을 평가하고 불확실한 상황 하에서의 합리적 의사결정을 위한 주요 개념과 방법을 살펴봅니다.

2. 기대효과

- ▶ 조사 분석, 현업 등에 위험 관리를 활용하기 위한 기초지식을 습득할 수 있음
- ▶ ModelRisk 소프트웨어에 대한 활용교육을 통해 종사하고 있는 업무 중 활용할 수 있는 부분을 생각해 낼 수 있음
- ▶ 위에서 실습한 소프트웨어를 활용하여 기존 자료를 어떻게 입력하며, 결과 도출 및 해석할 수 있는 능력을 배양할 수 있음, 이를 통해 실제 자료의 분석도 쉽게 처리할 할 수 있음

3. 교육개요

- ▶ 일 정 2013년 6월 28일 (금) 오후 3시 ~ 오후 5시 (2시간)

마스터즈타워 빌딩 회의실

- 주 소 : 서울특별시 마포구 도화동 553
- ▶ 장 소
 - 대중교통 : 공덕역(서울 지하철 5, 6호선, 경의선, 공항철도) 1번출구 마스터즈타워(시티은행 건물) 12층 회의실
 - 인터넷 지도 : <http://me2.do/xR4DyA5> (네이버)
 - 주 차 : 유료
- ▶ 인 원 최대 8명, 선착순 접수 (**접수기간 후 교육신청자가 일정 수 미만일 경우 연기**)
- ▶ 접수기간 2013. 6. 17 (월) ~ 2013. 6. 26 (수) 까지
- ▶ 참가비용 학생 → 10,000 원 일반인 → 20,000 원
- ▶ 준비물 **실습 소프트웨어가 설치된 개인 노트북 지참**
- ▶ 신청방법 참가신청서 메일 접수 → 접수 공지(메일, 전화) → 참가비 입금
- ▶ 접수관련 문의 02-707-1070 070 -7376- 3469
serve@expertchoice.co.kr kolee5678@daum.net

4. 약도



5. 실습 소프트웨어 다운로드 안내

ModelRisk 소프트웨어 체험판은 아래 페이지에서 다운로드 가능합니다.(15일 기간제한)
교육 당일에 실습을 원하시는 분은 지참하실 노트북에 소프트웨어를 미리 설치해 주시기 바랍니다.

- ① http://www.expertchoice.co.kr/down/modelrisksetup_SK.exe 클릭하여 파일 다운로드
- ② 프로그램 설치 (위 소프트웨어는 Microsoft Office Excel 이 설치되어 있어야 합니다.)

설치 시 문제가 발생할 경우에는 아래 연락처로 연락주세요.
전화번호 : 02-707-1070, 이메일 : serve@expertchoice.co.kr

[2013 의사결정 Day 6 교육 프로그램 일정표]

구분	내용	시간	비고
위험관리 소개	<ul style="list-style-type: none"> - 개요 및 필요성 - 몬테칼로 시뮬레이션 - 위험 분석 및 관리 절차, 유의점 - 활용분야 및 사례 소개 	20 분	PPT
ModelRisk 주요기능 실습	<p>ModelRisk 주요기능 따라해보기</p> <ul style="list-style-type: none"> - Monte Carlo simulation (몬테칼로 시뮬레이션) - 다양한 분포 생성 - 상관관계 Copula(연사) - 시계열 분석 - 과거 Data에 적합한 분포, Copula, 시계열 찾기 - 최적화 기능 - 전문가 의견 통합 	30 분	ModelRisk 화면 / 개인 노트북
휴식 / 실습환경 확인		10 분	
ModelRisk 활용예제	<ul style="list-style-type: none"> - 예제1: Correlated insurance portfolio(보험금 리스크 모델) 보험 상품 1년간 운용 → 예상 지출 보험금 예측 - 예제2: Cost and schedule(비용, 일정 리스크 모델) 새로운 건물 시공 → 예상 완료일, 총 비용 예측 	40 분	개인 노트북 활용
질의 및 강평		10 분	