



TEMARIO

Statistics for Risk Modeling



01

Modelos lineales y entendimiento estadístico

1. Regresión lineal simple.
2. Regresión lineal múltiple.
3. Validación del modelo.
4. Entendimiento estadístico.
5. Selección de variables.
6. Regresión ridge y lasso.
7. Interpretación de resultados en regresión.



02

Modelos lineales generalizados

1. Modelos lineales generalizados.
2. Regresión categórica.
3. Regresión de conteo.



03

Series de tiempo

1. Componentes de series de tiempo.
2. Series estacionarias y no estacionarias.
3. Modelos de suavizamiento y autorregresivos.



04

KNN y árboles de decisión

1. KNN.
2. Árboles de decisión.



05

Aprendizaje no supervisado

1. Análisis de componentes principales.
2. Clustering.

