



Descriptivo

Taller gratuito vía internet: Riesgo de crédito: Cálculo pérdida esperada y no esperada.

Descripción:

Se presentará la importancia de la medición del riesgo de crédito y cómo por medio del software Risk Simulator 2012 se puede calcular probabilidad de impago (default) de un grupo de clientes de una institución financiera, así como el cálculo de la pérdida esperada y no esperada para una cartera de clientes, finalmente se mostrará una modificación del modelo por medio de Simulaciones de Monte Carlo permitiendo mejorar en la cuantificación del riesgo.



Dirigido a:

Dirigido a estudiantes y profesionales que deseen utilizar las aplicaciones avanzadas que ofrece Risk Simulator para la gestión del riesgo de crédito. La presentación vía web busca exponer de una manera sencilla los temas teóricos y sin extenderse en los detalles de complicados modelos matemáticos.



Objetivo:

Presentar a través del software Risk Simulator cómo calcular la pérdida esperada y no esperada en el modelamiento del riesgo de crédito.



Temario:

1. Qué es Riesgo de Crédito?
2. Importancia de la medición del Riesgo de Crédito
3. Metodologías en la medición del Riesgo de Crédito
4. Estimación de probabilidades de incumplimiento
5. Cálculo de la pérdida esperada y no esperada, método tradicional vs. Monte Carlo
6. Conclusiones
7. Sesión de preguntas



Instructores: