



Descriptivo

Cálculo de probabilidades de Incumplimiento a través de un modelo de Riesgo de Crédito

Descripción:

Interactuando con el software Risk Simulator se abordaran los temas de Medición de riesgo de crédito, mostrando como estas herramientas ayudan al manejo, modelación y análisis de información financiera.



Dirigido a:

Personas interesadas en la Gestión Financiera, Control y Administración de Riesgos que deseen a través del modelo Logit y el uso de Risk Simulator obtener resultados avanzados, en términos estadísticos y financieros.



Objetivo:

Usar Risk Simulator para calcular la probabilidad de incumplimiento de una base de datos de clientes y encontrar la pérdida esperada de la empresa.



Temario:

Modelo Logit

Por medio de un ejemplo práctico se mostrará la importancia de la medición del riesgo de crédito y cómo se puede calcular la probabilidad de default de un grupo de clientes de una institución financiera.

Ajustes de Distribución

Calcular la probabilidad de incumplimiento de las diferentes carteras de clientes.

Cálculo de Pérdida Esperada

El cálculo de la pérdida esperada para una cartera de clientes utilizando simulaciones de Montecarlo con el apoyo del software Risk Simulator.



Instructores: