

# Webcast

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

### **Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.**

Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Gran Colombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

## Información General

## Duración

40 Minutos

## Fecha de Inicio

Vie. 13 de Jul de 2012

## Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 11:00 a.m

Bogotá 11:00 a.m

Quito 11:00 a.m

Lima 11:00 a.m.

Caracas 11:30 a.m

Bolivia 12:00 m.

Santiago 12:00 m

Buenos Aires 1:00 p.m

## Herramientas de apoyo



## Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora