

Webcast

Modelando la Probabilidad de Incumplimiento una Aplicación con EViews y Risk Simulator

Descripción

Toda Institución Financiera opera principalmente con una Cartera de Créditos y una Cartera de Inversión; la naturaleza misma de cada una requiere contar con herramientas y metodologías para su medición de manera de utilizar y aplicar un modelo adecuado para su correcto manejo; en esta oportunidad se realiza una aplicación de un modelo de Probabilidad de Incumplimiento para un cartera de créditos con el fin de modelar las principales variables que afectarían a la misma.

Dirigido a

Profesionales, docentes, investigadores, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en modelar el riesgo de crédito.

Objetivo

Revisar las principales herramientas y metodologías para modelar el riesgo de crédito. Mostrar la importancia de contar con un modelo de pérdidas esperadas de una cartera de créditos. Calcular la Probabilidad de Incumplimiento. Mostrar la aplicación con el uso de EViews y Risk Simulator a través de un mix de econometría y simulación de Montecarlo.

Temario

La gestión de riesgos y el riesgo de crédito. Principales herramientas para modelar el riesgo de crédito. El modelo de Perdidas Esperadas. Determinando la probabilidad de incumplimiento

Instructores

Félix Orlando López Alarcón

Economista de la Universidad Mayor de San Andrés, Magister en Finanzas, especializado en Riesgos Financieros, Finanzas y Métodos Cuantitativos. Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos (CQRM) por el Instituto IIPER y acreditado como Lead Risk Manager ISO 3100 Restrepo ORAMAS y ERCA de Europa. Cuenta con más de 15 años de experiencia, se ha desempeñado como Analista de Riesgos en Banco FIE, Jefe Nacional de Riesgos en CRECER IFD, Gerente de Riesgos Integrales en Banco de Desarrollo Productivo (BDP). Actualmente ejerce el cargo de director de Quántico Consultoría, Asesoría y Capacitación y se encuentra cursando el Doctorado en Economía.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Vie. 31 de Jul de 2015

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

Buenos Aires 1:00 p.m

Santiago 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