

Webcast

Uso de Stata 14 para Estimar la Pérdida de Incumplimiento en un Modelo de Riesgo de Crédito

Descripción

En muchos contextos económicos la variable de interés es una variable binaria, la cual se desea explicar por algunas variables independientes, en este tipo de casos el modelo lineal no es la manera apropiada para evaluar este tipo de modelos, por tanto, será necesario modelos de probabilidad, dentro de los cuales se encuentra el modelo Logit, Probit y Tobit. En periodos con bastante incertidumbre es necesario validar la calidad de cartera expuesta en un mercado financiero, bajo estas recomendaciones se promulga la medición del riesgo de crédito para estimar cual sería la pérdida esperada para provisionar a un institución financiera y en caso de que se supere esta pérdida, cuanto debería cubrir esta exposición con capital. De esta manera se hace relevante estimar la probabilidad de incumplimiento como insumo del cálculo de riesgo de crédito.

Dirigido a

Profesionales con conocimientos básicos en Riesgo y/o que quieran desempeñarse como analistas y modeladores; estudiantes, docentes y/o profesionales en áreas de estadística, economía, contaduría, riesgo, finanzas y demás áreas relacionadas con el tema.

Objetivo

Brindar a los participantes herramientas y metodologías para mitigar la incertidumbre y el riesgo, introduciéndolos en los conocimientos teóricos y metodologías de valoración de riesgos financieros. Desarrollar habilidades en el manejo de Stata 14 como herramienta de apoyo para el procesamiento de datos, análisis y toma de decisiones.

Temario

1. Introducción a los modelos con variable dependiente binaria
 - Limitaciones del modelo lineal.
 - Modelo Logit.
2. Modelo Logit para estimar la probabilidad incumplimiento en una cartera de clientes.
 - Estimación.
 - Interpretación de variables dicotómicas (odds ratio).
 - Interpretación de efectos marginales.
 - Validación (individual, global, especificidad y sensibilidad).
 - Pronóstico.
3. Modelo de riesgo de crédito
 - Introducción
 - Cálculo de la pérdida esperada
4. Preguntas.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Jue. 03 de Dic de 2015

Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m

México D.F. 9:00 a.m

Bogotá 10:00 a.m

Quito 10:00 a.m

Lima 10:00 a.m

Caracas 10:30 a.m

Bolivia 11:00 a.m

Buenos Aires 12:00 m

Santiago 12:00 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