

Webcast

Cadenas de Markov: Cálculo de Probabilidades de Incumplimiento a través de Matrices de Transición

Descripción

Presentación Online donde se mostrará la manera de calcular probabilidades de incumplimiento a través de las matrices de transición y como se puede realizar el rodamiento de la matriz para pronosticar comportamientos en el largo plazo.

Dirigido a

Profesionales, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender a como calcular probabilidades de incumplimiento a partir de matrices de transición como insumo para estimar las pérdidas esperadas en riesgo de crédito.

Objetivo

Utilizar Excel y Risk Simulator como herramientas para la medición de riesgos financieros. Estimar las probabilidades de incumplimiento a partir de matrices de transición.

Temario

1. Revisión teórica:
 - Procesos estocásticos
 - Proceso de Markov
 - Cadena de Markov
 - Chapman Kolmogorov
2. Estimación de la Matriz de Transición
3. Estimación de las Probabilidades de Incumplimiento
4. Calculo de las ecuaciones de Chapman Kolmogorov en Risk Simulator
5. Otras aplicaciones: Riesgo de Mercado

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 Nov de 2016

Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m

Bogotá 11:00 a.m

Quito 11:00 a.m

Lima 11:00 a.m

Caracas 12:00 m

Bolivia 12:00 m

Santiago 1:00 pm

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