

Webcast

Cuantificación de la probabilidad de incumplimiento con Risk Simulator

Descripción

En algunas preguntas de investigación en el campo económico y financiero la variable de interés es binaria, la cual podría ser explicada por variables independientes cuantitativas, cualitativas o ambas. En este tipo de casos, el modelo lineal no es la manera adecuada para responder preguntas de interés sobre el comportamiento de la variable dependiente, por tanto, será necesario aplicar el modelo Logit y Probit. En esta sesión, se abarcarán los fundamentos necesarios para la cuantificación de riesgo de crédito con apoyo de Risk Simulator. Se desarrollará un ejercicio aplicado involucrando técnicas econométricas y estadística inferencial.

Dirigido a

Analistas financieros, gerentes financieros y de riesgos, consultores financieros, analistas de riesgos, estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías, especialistas en finanzas, y en general todas aquellas personas interesadas en conocer las principales herramientas analíticas para la cuantificación de riesgo de crédito.

Objetivo

1. Estimar el modelo Logit y Probit para calcular la probabilidad de incumplimiento con apoyo de Risk Simulator y ROVBizStats.
2. Validar estadísticamente la selección del modelo a partir de la significancia estadística individual y global, tablas de clasificación y curva ROC.

Temario

1. Probabilidad de incumplimiento.
 - a. Principales conceptos.
 - b. Cálculo de la probabilidad de incumplimiento a partir del modelo Logit y Probit.
 - c. Interpretación de coeficientes.
 - d. Validación de los modelos estadísticos: significancia estadística de los parámetros y tabla de clasificación.
 - e. Gráfico ROC y calculo AUC.
 - f. Estimación y pronóstico de la probabilidad de incumplimiento.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA), además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 28 de May de 2021

Horarios

1:00 p.m San José de Costa Rica

2:00 pm Bogotá - Quito - Lima - CDMX

3:00 p.m La Paz - Caracas - Santiago de Chile

4:00 p.m Buenos Aires



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