

# 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 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

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

### 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