

Módulo VII

Virtual en Vivo

Análisis de Supervivencia en Modelos de Riesgo de Crédito

Brindar a los participantes las metodologías modernas de gestión de riesgos que vienen aplicando las entidades que participan en el sistema financiero, para la evaluación, administración y control de sus créditos, enfocado desde el punto de vista de la propia entidad, así como de los diferentes organismos de control externos a los que se encuentran sometidas.

INICIO

30

Sábado
Mayo

5 Sesiones (16hrs)

Sábado y Domingo
7 am - 10 am

Costo

\$ 480 + IGV

TEMAS

- Conceptos básicos de análisis de supervivencia
- ¿Por qué es importante determinar el tiempo hasta el default en riesgo de crédito?
- Exploración de variables usando funciones de supervivencia y ratios de riesgos (Kaplan–Meier y Nelson–Aalen)
- Modelos de riesgos proporcionales de Cox
- Modelo de Cox con covariables dependientes del tiempo
- Modelos de eventos recurrentes
- Modelos de riesgos competitivosmodelos

DOCENTE

MSc en Economía. con especialización en econometría Profesional con experiencia en el desarrollo de modelos analíticos de riesgos. Experiencia como expositor en cursos relacionados a riesgos financieros, estadística y econometría aplicada.



Mayor Información

✉ info@quants-group.com
☎ 00 51 938 117 737

www.quants-group.com