

Modeling
Modeling
Debtors
Credits
Credits

Modelos Estadísticos para la Gestión de Riesgos de Crédito



Modeling


Management



JULIO 2019

CIUDAD DE PANAMÁ, REP. DE PANAMÁ
IBI UNIVERSIDAD BANCARIA

Risk
RiskMathics
FINANCIAL INSTITUTE



RiskMathics, empresa dedicada a la investigación, análisis e impartición de cursos de vanguardia en las áreas de Administración de Riesgos, Trading, Productos Derivados y Finanzas Cuantitativas, ofrecerá uno de los cursos más reconocidos a nivel mundial en el campo de Riesgo de Crédito, contando con maestros y expositores de reconocimiento local e internacional.

Los últimos acontecimientos de bancarrota y eventos de crédito, resultado de la primera Crisis Global, han llevado a las instituciones financieras a replantearse el papel del Riesgo de Crédito y de cómo tener mejores elementos y parámetros para poder medirlo, cuantificarlo, administrarlo y la posibilidad de anticiparse a cualquiera de estos sucesos, varios de estos elementos y prácticas contenidos en el nuevo marco de Basilea III.

Es por ello, que hoy más que nunca es necesario que dichas Instituciones cuenten con Capital Humano preparado y capacitado para poder controlar cualquier evento de crédito que pueda poner en riesgo el futuro de la organización.


OBJETIVO

Dotar a los participantes de los últimos avances y de herramientas de vanguardia a nivel mundial para medir, modelar y administrar el Riesgo de Crédito.

METODOLOGÍA

El curso incluirá exposiciones por parte del instructor pero tendrá un enfoque principalmente práctico a través de la resolución de ejemplos y el análisis de casos.

¿QUIÉNES LO DEBEN DE CURSAR?

- Tesoreros
 - Corporativos
 - Administradores de Riesgos
 - Áreas de Crédito
 - Reguladores
 - Académicos
 - Financieros
 - Personal involucrado en Cámaras de Compensación y Liquidación
 - Quants
 - Traders
 - Áreas de Crédito y Préstamo de Instituciones Financieras
 - Bancos
 - Fondos de Pensiones
 - Aseguradoras
 - Reaseguradoras
 - Casas de Bolsa
 - Sociedades de Inversión
 - Hedge Funds
 - Asset & Fund Managers
- 



MAURILIO PATIÑO
 Director de Riesgos
 Genworth

MODELOS ESTADÍSTICOS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO

EXPOSITOR

Maurilio Patiño actualmente es Director de Riesgos de GENWORTH. Anteriormente, fungió con el mismo cargo para Banco Itaú Chile y para Banco Wal-Mart en la Ciudad de México. También fue responsable de riesgos de Bank of America y responsable de riesgos de mercado en Bank Boston México, así como Subdirector de Administración de Riesgos en Bital, México.

Adicionalmente tiene experiencia como consultor actuarial, habiendo trabajado con William M. Mercer. Su experiencia como docente ha sido desarrollada en los últimos 12 años en diversas instituciones, impartiendo cursos relacionados con valuación y cobertura de instrumentos derivados, modelación matemática y medición de riesgos.

Maurilio es Actuario egresado de la Universidad Anáhuac y cuenta con una Maestría en Métodos Matemáticos para Finanzas por la misma Universidad en la Ciudad de México.

TEMARIO:

1. Introducción al Riesgo de Crédito y a la Normatividad
 - 1.1. Introducción a la gestión del riesgo de crédito
 - 1.1.1. Cuantificación del Riesgo de Crédito: Pérdida Esperada y No Esperada
 - 1.1.2. Indicadores para el seguimiento y control de una cartera crediticia
 - 1.1.3. Pricing basado en riesgo
 - 1.2. Acuerdos de Basilea y Normatividad Vigente
 - 1.3. Elementos de un Sistema de Administración de Riesgos
 - 1.4. Uso de modelos estadísticos para la gestión del riesgo
2. Uso de modelos estadísticos para la gestión del riesgo de crédito
 - 2.1. Introducción al crédito al consumo y a los modelos de
 - 2.1.1. Herramientas de decisión: diagramas de influencia, árboles de decisión y árboles de estrategias
 - 2.1.2. Probabilidades, momios(odds), información y puntajes
 - 2.1.3. Modificando scores: escalamiento, niveles múltiples y dependencia del tiempo
 - 2.1.4. Gestión a través de estimaciones de pérdida esperada
 - 2.1.5. Rendimientos esperados y costos
 - 2.1.6. Fundamentos de la construcción de modelos de puntaje
 - 2.1.7. Uso de las regresión logística para construir modelos de puntaje
 - 2.2. Administración de sistemas de puntuación (scoring systems)
 - 2.2.1. Medición de la calidad de la tabla de puntuación
 - 2.2.2. Medición del poder discriminante y del desempeño
 - 2.2.3. Segmentación del Scorecard y medición de su impacto en la discriminación
 - 2.3. Administración de cuentas
 - 2.3.1. Modelos de comportamiento (Behavioral scoring) y administración óptima de cuentas
 - 2.3.2. Estrategias de cobranza y recuperación
 - 2.3.3. Administración de límites
 - 2.3.4. Ventas cruzadas

HORARIO: 8:00 AM - 5:00 PM
DURACIÓN: 2 CLASES (16 HORAS)

JULIO

D	L	M	M	J	V	S
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19	20
21	22	23	24	25	26	27
28	29	30	31			

CALENDARIO 2019

REGISTRO E INSCRIPCIONES

E-mail: derivatives@riskmathics.com / kleon@riskmathics.com
Tels.: +52 (55) 5536 4325 y +52 (55) 5638 0907

E-mail Panamá: informacion@ubancaria.ac.pa / inscripcionesinstitutobancario.org
Teléfono Panamá: 507 263 2031

Sede: IBI Universidad Bancaria. Torre Banco Delta, Piso # 1, Calle Elvira Méndez,
Ciudad de Panamá, Panamá.

COSTO: \$1,300 USD

(*Esta cantidad deberá ser cubierta neta, es libre y exenta de cualquier impuesto,
comisión y /o retenciones locales)

CUPO LIMITADO

OPCIONES DE PAGO:

1. Transferencia Bancaria en Dólares
(RESIDENTES E INSTITUCIONES ESTABLECIDAS EN EL
EXTRANJERO)

BANCO: BBVA Bancomer

SUCURSAL: 0956

SWIFT: BCMRMXMM

BENEFICIARIO: RiskMathics, S.C.

CUENTA: 0121 8000 11 0583 0066

2. Opción de Pago en Panamá:

Depósito en cuenta N° 015-021-00069866-003

Del Instituto Bancario Internacional (IBI) en Banco Delta,
Ciudad de Panamá, Rep. de Panamá.



NOTA IMPORTANTE: No existen reembolsos ni devoluciones