



BDV InnovaRisk Consulting

TRUSTED · VALUED · DELIVERED

**Te acompañamos en
tu camino al éxito**



CURSO: Gestión de Riesgos de Modelos

BDV InnovaRisk Consulting

 +507 6299 9913

 +51 947 369969

 +1 416 562 5996

Info@bdvinnovarisk.com

www.bdvinnovarisk.com

CURSO: Gestión de Riesgos de Modelos

Dirigido a profesionales que se desempeñan en las áreas de riesgos, cumplimiento, auditoría y otras áreas que tienen la responsabilidad de implementar lo dispuesto en la Resolución SBS N° 053-2023 o de validar dicho cumplimiento.

Características del curso:

- Expositor: **Eduardo Bastante**
- El curso se realizará virtualmente los días **17, 18 y 19 de julio de 2024** de 9 AM a 1 PM.
- Duración total de 12 horas.
- El material será enviado por correo electrónico antes del curso.



Aspectos Generales y Gobierno



Desarrollo, Implementación y Seguimiento de Modelos



Validación de Modelos y Tercerización

Fecha: 17/07/2024

Horario: De 9 AM a 1 PM

Temario:

- Definición de modelo y riesgo de modelo
- Inventario de modelos
- Etapas en gestión de riesgo de modelo
- Clasificación de la importancia de modelos
- Políticas y controles necesarios
- Roles y responsabilidades

Fecha: 18/07/2024

Horario: De 9 AM a 12 PM

Temario:

- Objetivo del modelo, alcance y diseño
- Calidad de datos
- Definición de la variable objetivo
- Tratamiento de las variables explicativas y estabilidad de predicción
- Estándares en el proceso de modelación
- Ajustes del modelo y criterio experto
- Performance esperado de indicadores clave
- Sesgo de selección y aplicación de modelos
- Reporte y mitigantes

Fecha: 19/07/2024

Horario: De 9 AM a 12 PM

Temario:

- Autoevaluación y desarrollo de limitantes
- Tipología de debilidades y consecuencias
- Estrategias de validación de la calidad de información
- Alcance de la revisión o replicación de modelos
- Integración dentro de la cultura de riesgos
- Alcance de la tercerización en la modelación

Eduardo Bastante



QF, peruano, Consultor Internacional. Máster en Finanzas Cuantitativas por la Universidad de Alcalá de Henares (Madrid – España). Bachiller en Economía por la Universidad del Pacífico. Cuenta con experiencia de 7 años como intendente de riesgos de crédito de la Superintendencia de Banca Seguros y AFPs (2010 al 2017) y con 10 años adicionales de experiencia en la supervisión de metodologías internas de riesgos de crédito, mercado y liquidez, así como desarrollo de la regulación sobre riesgo de crédito. Consultor experto del Fondo Monetario Internacional en temas de desarrollo y validación de modelos de riesgo de crédito, metodologías de estrés financiero y desarrollo de normativa financiera. Profesor en escuelas de negocios, maestrías y certificaciones sobre metodologías de estrés, modelación y gestión de riesgos de crédito, mercado y liquidez. Actualmente, se encuentra desarrollando metodologías de scoring, estrés, sobre endeudamiento, indicadores de apetito por riesgo, riesgo de modelo y reporting en instituciones financieras locales e internacionales.



PRECIO REGULAR

\$ 425

sin IGV

Incluye material

15% descuento por
pagos antes del
21.06.2024

\$ 360

sin IGV

(*) Precio por persona

PRECIO CORPORATIVO

\$ 354

sin IGV

Incluye material

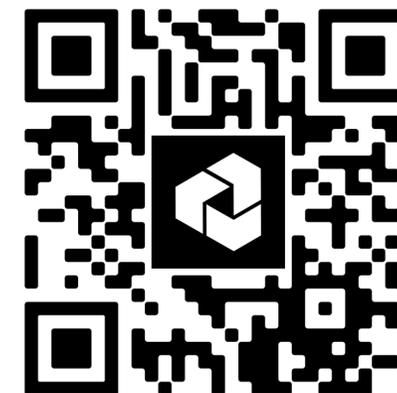
15% descuento por
pagos antes del
21.06.2024

\$ 300

sin IGV

(**) Precio individual para 3 o más
asistentes, o para clientes actuales

Para inscribirse ingrese a la página web:
<https://bdvinnovarisk.com/riesgo-modelos>





BDV InnovaRisk Consulting

TRUSTED · VALUED · DELIVERED

**Te acompañamos en tu
camino al éxito**



**Confianza,
Innovación y
Experiencia**

BDV InnovaRisk Consulting

 +507 6299 9913

 +51 947 369969

 +1 416 562 5996

Info@bdvinnovarisk.com

www.bdvinnovarisk.com