



**QuantsGroup**  
Professional Training



**CURSO VIRTUAL**

9, 11, 16, 18 y 23  
**AGOSTO**

**2022**

**MAR / JUE**

**15 HORAS** (19:00 - 22:00)

5 SESIONES  
DE 3 HORAS

HORA PERÚ



# GESTIÓN DEL RIESGO DE MODELO

Alineado con la prepublicación del regulador peruano (SBS) del reglamento para la gestión del riesgo de modelo

## TEMARIO

**Módulo I:** introducción al Riesgo de Modelo

**Módulo II:** Gestión del riesgo de modelo

**Módulo III:** Validación de Modelos

**MAYOR INFORMACIÓN**



**+ 51 938 117 737**

Idioma de la clase: **Español**

Idioma del material: **Español**

Grabación de clase: **NO**

**INVERSIÓN: USD 400 + IGV**

## Módulo I: Introducción al Riesgo de Modelo

- Aspectos regulatorios
  - Prepublicación SBS del reglamento para la gestión del riesgo de modelo
- Definición de riesgo modelo
- Gestión del riesgo modelo
- Definición de modelo
- Fuentes del riesgo modelo
  - Data
  - Estimación
  - Uso
- Inventario de modelos de riesgos
- Metodología de control
- Gestión de procesos y tecnología
- Gobernanza
- Gestión del ciclo de vida de los modelos
- Cuantificación del riesgo modelo
- Ciclo de la gestión cuantitativa del riesgo modelo
- Identificación de la fuente
- Mitigación del riesgo modelo
- Documentación de modelos
- Validación de modelos
- Perfil de equipos de riesgo de modelo en entidades financieras
- Estructura y organigrama
- Principales actividades del equipo
- ¿Cómo realizar un inventario de modelos?

## Módulo II: Gestión del riesgo de modelo

- Gobernanza en el riesgo de modelo
  - Rol del consejo y alta dirección
  - Rol del departamento de riesgos
  - Responsables y creadores del modelo
  - Comités
  - Auditoría interna
  - Definición de políticas
- Organización
  - Tres líneas de defensa
  - Comunicación interna y externa
  - Fases del Ciclo de vida del modelo
  - Identificación
  - Inventario de los modelos
  - Clasificación
  - Niveles o "Tiering" en función a materialidad, sofisticación e impacto
  - Planificación y desarrollo
  - Validación interna
  - Documentación
  - Aprobación del modelo
  - Implementación y uso del modelo
  - Monitorización del modelo
  - Mejores prácticas internacionales de gestión del riesgo modelo
- Mitigación del riesgo de modelo
- Model risk appetite
- Medición cualitativa del riesgo de modelo

### Módulo III: Validación de Modelos

- Lecciones aprendidas en la crisis financiera sobre validación
  - Validation Framework
  - Definición de Validación
  - Principios de validación
  - Roles y Responsabilidades
  - Alcance y frecuencia
  - Proceso de Validación
  - Gobernanza Interna
  - Validación Cualitativa
- Model Design
  - Data Quality
  - Use Test
- Validación Cuantitativa
  - Infraestructura tecnológica
  - Documentación Requerida
  - Departamento y equipo de validación interna
  - Departamento y equipo de Auditoria

## Docente



Profesional con mas de 15 años de experiencia en el sector financiero. Cuenta con estudios de posgrado en Finanzas Cuantitativas y Gestión de Riesgos. Cuenta con experiencia en la gestión del riesgo de modelo en entidad financiera. Tiene amplia experiencia docente en prestigiosas instituciones nacionales e internacionales.

## Agosto 2022

Dom	Lun	Mar	Mié	Jue	Vie	Sáb
	1		3		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			

**INVERSIÓN**  
**US\$ 400**  
**+ IGV**

**Depósito: A nombre de Grupo Quants SAC / RUC: 20606014172**  
**Cta Cte en SOLES BCP: 192-8751132-0-71 - CCI N°: 00219200875113207132**  
**Cta. Cte. en DOLARES BCP: 192-9405810-1-90 - CCI N° 00219200940581019031**  
**Cta de Detracción en SOLES Banco de la Nación N°: 00-012-059906 (10%)**