

## Módulo VIII

Virtual en Vivo

# Modelos

# de Riesgo de Crédito IFRS9 e IRB

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

# 27

Sábado  
Junio

10 Sesiones (30hrs)

Sábado y Domingo  
7 am - 10 am

Costo  
\$ 900 + IGV

## TEMAS

- Modelos de predicción de PE (regresiones ARIMAX)
- Modelos de predicción PD IRB (reg. logit, cox, datos de panel)
- Modelos de predicción PD IFRS 9:
  - > Matrices transición, lifetime, PIT, TTC
- Calibración de PD IFRS9 y PD IRB
- Modelos de predicción LGD IRB:
  - > Regresiones beta, respuesta fraccional, otras
- Modelos de predicción LGD IFRS 9
- Modelos de predicción EAD IRB:
  - > Regresiones beta, respuesta fraccional, otras
- Modelos de predicción EAD IFRS 9
- Validación (Backtesting de PD, LGD, EAD)
- Modelos Forward Looking
- Análisis de Escenarios
- Stress Testing

## 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](mailto:info@quants-group.com)  
☎ 00 51 938 117 737

[www.quants-group.com](http://www.quants-group.com)