

Validación y

# Medidas de Riesgo de Modelo

En este curso se dotará al participante de conocimientos para distinguir las fuentes de riesgo de modelo, a través de proceso de identificación, medición y mitigación. Conocer la evolución natural de la función de segunda línea de defensa y alineado a normativa internacional relacionada a riesgo de modelo.

## TEMAS

- Control y Validación del Riesgo de Modelo
- Procesos clave de la validación
- Medición del riesgo de modelo individual y Portafolio
- Evaluación del modelo en continuidad
- Métrica de apetito al riesgo de modelo
- Reporting de riesgo de modelo

## Módulo IV

Virtual en Vivo



## INICIO

**11** Sábado  
Abril

1 sesiones

Sábado  
**8:30 am - 11:30 am**  
(hora de Perú)


### COSTO

US\$ 120 + IGV

### Alineado a tendencia internacional

- ECB-Targeted Review of Internal Models (TRIM)
- Model Risk Management, SR 11-7
- The European Insurance and Occupational Pensions Authority (EIOPA)
- The UK Prudential Regulation Authority (PRA)

## Plana Docente

-  Experto en riesgo con mas de 20 años de experiencia. Experiencia profesional en instituciones de renombre tales como: Banesto y Banco Santander, ocupando puestos como Director de Middle Office, Director de Riesgo de Tesorería, Director de Validación de Riesgos Financieros, Responsable de Validación de modelos ALM, Responsable de Riesgo de Modelo.



## Mayor Información

✉ [info@quants-group.com](mailto:info@quants-group.com)

☎ +51 938 117 737

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