

Métricas

Módulo IV

Virtual en Vivo

para la validación de modelos

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.

TEMAS

- Benchmarking
- Métodos estadísticos para validación
- Validación de parámetros de RC
- Validación del poder discriminante/predictivo
- Técnicas para definir el punto de corte de score
- F1-Score, matriz de confusión
- Interpretación de los resultados de validación
- Enfoque de negocio y regulatorios de modelos
- Comparativa de modelos
 - > Parametric models
 - > Machine Learning
- Diseño de estrategias

INICIO

21 Sábado
Marzo

3 Sesiones (8hrs)

Sábado y Domingo
7 am - 10 am

Costo
\$ 240 + IGV

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
☎ 00 51 938 117 737

www.quants-group.com