

# CONSTRUCCIÓN Y VALIDACIÓN DE MODELOS INTERNOS CLÁSICOS Y DE MACHINE LEARNING

machine learning

La incorporación de **modelos de machine learning y datos masivos** en la **gestión del riesgo** es una tendencia creciente

CURSO



**DURACIÓN**

1 mes



**MODALIDAD**

Sincrónica y Asincrónica



**ENFOQUE PRÁCTICO**

Conceptos de gestión en situaciones reales



**DEDICACIÓN**

20h

## OBEJTIVOS

En muchos mercados financieros, las regulaciones exigen que las instituciones tengan **modelos internos sólidos para evaluar y gestionar el riesgo**. Un programa de este tipo proporcionará una comprensión profunda de las normativas aplicables, como los requisitos de Basilea y las normas IFRS 9, lo que garantiza que los profesionales en riesgos estén actualizados en cuanto al cumplimiento

## PROGRAMA

- Introducción a la gestión del riesgo de modelo.
- Definición de Modelo
- Ciclo de vida del modelo.
- Inventario de Modelos
- Gestión en base al Tearing de modelos.
- Gobierno y Clasificación de cambios en modelos
- Cuantificación del Riesgo de Modelo
- Conceptualización del Riesgo de Crédito
- Caso particular: Modelos IRB, IFRS9 y Stress Test
- Alternativas a modelos estadísticos: Modelos mixtos / no cuantitativos / genéricos (elaborados por terceros/vendors).
- Tendencias recientes y retos.



+34 918599010



info@nemesisrisk.com



WWW.NEMESISRISK.COM