



IMF CONSULTING SAC
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

RISK-12: MODELOS ECONOMETRICOS PARA LA GESTION INTEGRAL DE RIESGOS

OBJETIVO:

El curso 100% práctico, está dirigido a los miembros de las organizaciones con funciones y responsabilidades relacionadas a la gestión de los riesgos financieros y no financieros de la empresa. Se ofrecerá a los participantes las herramientas necesarias para la creación de modelos cuantitativos conforme a las buenas prácticas de gestión de riesgos, elaboradas por la Superintendencia de Banca y Seguros (SBS) y los principios de riesgos internacionalmente aceptados (GARP).

TEMARIO:

Revisión de Métodos Numéricos para Evaluar Riesgo de Crédito (I parte):

(Utilización de plantillas en Excel)

1. Enfoque de Provisiones Genéricas y Específicas. 10 casos prácticos.
2. Enfoque de Análisis de Estados Financieros y ratios. 01 caso para Pymes.
3. Enfoque de Evaluación Cualitativa, las 5 C's de Créditos. 04 casos: Mes, Agrícola, Consumo e Hipotecario.
4. Enfoque del Organismo Regulador en Visitas In Situ. Revisión de plantilla según la Res. SBS N° 11356

Revisión de Métodos Numéricos para Evaluar Riesgo de Crédito (II parte):

(Utilización de plantillas en Excel e Internet)

5. Enfoque de Pérdidas Esperadas: PD, EAD, LGD. 09 casos prácticos.
6. Enfoque de Pérdidas No Esperadas. 04 casos prácticos.
7. Enfoque de Alertas Tempranas, según Z-Altman , 01 caso para entidades de microfinanzas
8. Enfoque de Central de Riesgo de Sentinel: 05 Casos.

Revisión de Métodos Numéricos para Evaluar Riesgo de Crédito (III parte):

(Utilización de plantillas en Excel)

9. Enfoque de Modelos de Predicción utilizando MCO: Caso Econométrico.
10. Enfoque de Scoring de Admisión. 03 casos: Consumo, Pymes y Comercial.
11. Enfoque de Modelación de la PD a través de Logit & Probit: 01 caso
12. Enfoque de Modelación de la PD a través de Análisis por Cosechas: 01 caso
13. Enfoque de Modelación de la FCC (Factor de Conversión Crediticia), a través de MCO: 01 caso
14. Enfoque de CrediMetric y Matrices de Transición: 01 caso (J.P Morgan CreditMetrics™— Technical Document)

Contacto: Mauro Alva Neyra. **WhatsApp:** [+51 990891183](tel:+51990891183)

Email: malva@imfconsultingsac.com | gerencia@imfconsultingsac.com

Web: www.imfconsultingsac.com



IMF CONSULTING SAC
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

15. Visualización de Video utilizando Risk Simulator para la Gestión de Riesgo de Crédito

Revisión de Métodos Numéricos para Evaluar Riesgo de Mercado:

(Utilización de plantillas en Excel)

16. Enfoque de VaR Parametrico. 01 caso.
17. Enfoque de VaR Histórico. 01 caso.
18. Enfoque de VaR Simulación Montecarlo. 01 caso.
19. Enfoque de VaR Portafolio de Inversión. 01 caso de 17 acciones BVL.
20. Visualización de Video utilizando Risk Simulator para la Gestión de Riesgo de Mercado.

Revisión de Métodos Numéricos para Evaluar Riesgo de Operacional:

21. Enfoque Cualitativo para la Gestión de Riesgo Operativo aplicando la ISO 31000-2009 “Gestión de Riesgos- Principios y Directrices”. 01 caso para entidades de microfinanzas.
22. Revisión de un Software (macro) para la Gestión de Riesgo Operativo, según el Estándar Australiano AS/ANZ 4360:1999.

DURACION: