



ASBA

ASOCIACIÓN DE SUPERVISORES BANCARIOS DE LAS AMERICAS



Curso en Línea: Herramientas Estadísticas para Revisión de Modelos de Provisiones

INSTRUCTOR

Banco de España

FECHA

6, 8, 9, 13 y 16 de mayo

HORARIO

08:30 am a 12:00 h (horario de México)

IDIOMA

Español

CUPOS

2 participantes por institución

FECHA LÍMITE DE REGISTRO

25 de abril

CONTACTO

Nancy Vallejo Guerra / Coordinación de Programas y
Eventos

vallejo@asbasupervision.org



Perfil del Participante

DIRIGIDO A:

Supervisores encargados de la revisión de modelos de provisiones colectivas o el seguimiento de los mismos.



Panorama General

La entrada en vigor de la IFRS 9 ha supuesto un cambio de paradigma en el cálculo de provisiones por riesgo de crédito y ha motivado la lógica atención del supervisor prudencial sobre el cálculo de provisiones colectivas.

En la revisión de las mismas se ha puesto de manifiesto la necesidad de reforzar el conocimiento y la aplicación de las herramientas cuantitativas a disposición de los inspectores. Este tipo de herramientas son cruciales en la revisión de los modelos internos de medición de riesgo de crédito (concesión, precio, seguimiento, clasificación y otros) y en particular de los modelos de estimación colectiva de provisiones por riesgo de crédito.

En esta edición se trabajará con ejemplos reales extraídos de inspecciones de la supervisión del Banco de España sobre:

- a) Réplicas de cálculos
- b) Diferentes pruebas para evaluar la razonabilidad de la metodología y de las bases de datos utilizadas en la construcción de los métodos y
- c) Revisiones cuantitativas de las provisiones calculadas

IMPORTANTE:

Las sesiones online no serán estrictamente el contenido del curso. El contenido del curso será la combinación de tres componentes: material proporcionado por los ponentes, clases online y video tutoriales.



Λ S B Λ

ASOCIACIÓN DE SUPERVISORES BANCARIOS DE LAS AMERICAS



Requisitos

IMPORTANTE:

El software "R" y "R-estudio" tendrán que estar instalados en los equipos con objeto de hacer las prácticas del curso. Se trata de un software libre, cuya instalación requerirá de las autorizaciones internas de cada institución.

Para la realización del curso no es imprescindible conocer previamente el software porque se va a dar una introducción al mismo.

*Cumplimiento total de las horas para emisión del certificado de participación.



Λ S B Λ

www.asbasupervision.com

BANCO DE **ESPAÑA**
Eurosistema

www.bde.es