

I. Rekomendacja W

- Wymogi

II. Model

- Definicja modelu
- Cykl życia modelu
- Rodzaje modeli
- W jaki sposób zdefiniować model (case study na wybranych modelach)

III. Zarządzanie ryzykiem modeli

- Dziennik modelu
- Rejestr modeli
- Ocena istotności modeli
- Poziom ryzyka modelu
- Uczestnicy procesu
- Opracowanie i uzupełnienie dziennika modelu (case study)
- Pomiar ryzyka modelu (case study)
- Ocena istotności modelu (case study na wybranych modelach)

IV. Walidacja modeli

- Organizacja procesu walidacji
- Raporty walidacyjne
- Techniki walidacji
- Obszary poddane walidacji (case study – dyskusja)

V. Rola audytu w procesie zarządzania ryzykiem modeli

- Organizacja procesu audytu
- Raporty audytu
- Możliwe podejścia do audytu modeli
- Obszary poddane audytowi (case study – dyskusja)

VI. Proces raportowania ryzyka modeli

- Cel
- Odbiorcy
- Zakres
- Wnioski
- Przykładowe raporty (case study na wybranych przykładach)

VII. Ocena działania modeli

- Miary statystyczne
- Metody eksperckie

Profil

Szkolenie jest przeznaczone przede wszystkim dla pracowników departamentów / jednostek:

- zarządzania ryzykiem kredytowym
- walidacji
- audytu wewnętrznego
- pracowników odpowiedzialnych za proces ICAAP

Poziom

Szkolenie przeznaczone jest dla osób posiadających podstawową lub średnią wiedzę z zakresu budowy modeli ryzyka kredytowego w banku oraz ich wykorzystania w obszarze ryzyka.

Metodyka

Szkolenie prowadzone będzie w formie wykładu połączonego z warsztatami.