

QuantUp
Artur Suchwaiko
+48-780-085-300
artur@quantup.pl
<http://www.quantup.pl>

Program szkolenia

Budowa i walidacja modeli LGD i CCF

Prowadzący: Tomasz Terlikowski

1. Wymagania nadzorcze stawiane modelom LGD i CCF (prezentacja)
 - omówienie wymagań stawianych w Uchwałach KNF, GL10, WP14, CRD IV
 - kwestie problematyczne a podejście praktyczne
2. Zakres danych potrzebnych do budowy modeli LGD i CCF (prezentacja)
 - minimalny zakres danych potrzebny do budowy modeli LGD i CCF
 - czyszczenie danych na potrzeby budowy modeli LGD i CCF
3. Metody kalkulacji parametrów LGD i CCF (prezentacja + warsztaty)
 - omówienie metod stosowanych do budowy modeli LGD i CCF
 - wady i zalety stosowanych metod
 - metody kalkulacji vs. wymogi regulacyjne
 - ćwiczenia praktyczne
4. Walidacja modeli LGD i CCF (prezentacja + warsztaty)
 - omówienie metod walidacji jakościowej oraz ilościowej modeli LGD i CCF
 - walidacja danych w zakresie modeli LGD i CCF
 - miary statystyczne wykorzystywane do walidacji modeli LGD i CCF
5. Zakres raportowania w ramach modeli LGD i CCF, proces eskalacji wyników walidacji (prezentacja)
6. Use test dla modeli LGD i CCF (prezentacja)
7. Kwestie problematyczne: definicja default, cure rate, okres kwarantanny, vintage, recovery rate, stopa dyskontowa, downturn, błędy oszacowań (prezentacja)