

**QuantUp**  
**Artur Suchwaiko**  
+48-780-085-300  
[artur@quantup.pl](mailto:artur@quantup.pl)  
<http://www.quantup.pl>

## **Program szkolenia**

# **Zarządzanie modelami ryzyka kredytowego: budowa, monitoring i walidacja w kontekście wymogów Rekomendacji W**

**Prowadzący: Tomasz Terlikowski**

1. Zarządzanie ryzykiem modeli
  - proces i organizacja
  - workflow dla modeli
  - cykl życia modeli
2. Polityka zarządzania ryzykiem modeli – w skrócie
  - rejestr modeli
  - mapa modeli i ich powiązań
  - istotność modeli
  - poziom ryzyka modelu
  - karty modeli
  - zintegrowana ocena ryzyka modeli
  - strategia dla ryzyka modeli
3. Ocena działania modeli
  - miary statystyczne
  - praktyka rynkowa
  - złote zasady
4. Monitoring a walidacja modeli
  - organizacja procesu monitoringu i walidacji: umiejscowienie komórki walidacyjnej, komitet ds. walidacji
  - raporty z walidacji
5. Raportowanie w zakresie ryzyka modeli
  - po co to robić
  - odbiorcy
  - zakres
  - wnioski z raportowania