

RISCO, CAPITAL E STRESS TESTING

Validação de Modelos e Model Risk Management

Para risco e validação: planejar testes, avaliar dados e desempenho dos modelos e documentar limitações, achados e medidas corretivas.

DURAÇÃO	NÍVEL	FORMATO	IN-COMPANY
16h	Avançado	Online ao vivo ou presencial	Adaptado à instituição

O que resolve

Os modelos usados em decisões de crédito e de capital precisam de evidência sobre a qualidade dos dados, o desempenho e a estabilidade, e é a validação independente que a produz. Com casos de risco de crédito, os participantes estruturam inventário e tiering, planeiam uma validação, executam testes ilustrativos de desempenho, estabilidade e backtesting, discutem a explicabilidade de modelos de IA e documentam achados e remediação. Levam modelos de inventário, de relatório de validação e de matriz de achados.

O que vai conseguir fazer

- Compreender o ciclo de vida dos modelos e as fontes de risco de modelo
- Estruturar inventário, tiering e governação de modelos
- Planejar e executar uma validação independente
- Aplicar testes de desempenho, estabilidade, backtesting e benchmarking
- Documentar achados e acompanhar planos de remediação

Para quem

Validação de modelos, risco, auditoria quantitativa, analytics e supervisão.

Pré-requisitos

Conhecimentos de estatística e familiaridade com modelos de risco de crédito, de mercado ou atuariais. Não exige programação.

Programa

- 1 Risco de modelo, ciclo de vida e governação
- 2 Inventário, tiering e independência da validação
- 3 Qualidade de dados, desempenho, estabilidade e backtesting
- 4 Benchmarking, modelos challenger e explicabilidade de modelos de IA
- 5 Relatório de validação, achados e remediação

Como aprende

Casos práticos sobre modelos de risco de crédito, exercícios de teste e análise crítica de documentação de modelos.

O que leva consigo

- Template de inventário e tiering de modelos
- Checklist de validação independente
- Modelo de relatório de validação
- Matriz de achados e remediação

Resultados esperados

O participante consegue planear e conduzir uma validação independente, documentar achados e contestar tecnicamente um modelo de forma sustentada.

Equipa formadora

Formadores com experiência prática na banca e no setor financeiro, que combinam rigor técnico com casos aplicados ao mercado angolano.

Formação in-company

Adaptamos casos, exemplos e duração à realidade de cada instituição, com dados fictícios ou anonimizados. A formação decorre online ao vivo ou presencialmente, nas instalações da instituição ou na Católica Luanda Business School.

Pedir proposta in-company

[Ver o curso e pedir proposta](#) · formacao@abf-angola.com