

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

INFORME N° 0017-2024-HUM110-N

TÉRMINOS DE REFERENCIA

Requerimiento: Course Building an ALM & Balance Sheet Optimization Model

Objetivo del curso:

En esta formación, inspirada en el libro "ALM Modeling and Balance Optimización de hojas: un enfoque matemático de la banca" por Diogo Gobira y Lucas Processi, los participantes aprenderán a hacer un balance modelo de optimización mediante programación dinámica estocástica. En este curso se verá desde capas de datos hasta decisiones variables, restricciones comerciales y regulatorias, funciones objetivas, estrategias de modelado, técnicas de resolución, depuración y generación de informes. En este curso se proporcionará las herramientas de última generación para optimizar el rendimiento del banco, ofreciendo conocimientos y habilidades invaluable para una implementación efectiva.

Metodología:

El curso considera una metodología teórica-práctica, en la modalidad virtual.

Participantes:

2 participantes

Duración:

06 meses

Lugar:

El curso se desarrollará en modalidad virtual, con sesiones síncronas.

Material didáctico:

El proveedor proporcionará el material de enseñanza.

Forma de pago:

Pago único, previa conformidad del Departamento de Desarrollo de Personal.

Conformidad:

Departamento de Desarrollo de Personal.

Departamento de Desarrollo de Personal

Lima, 07 de febrero de 2024

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

FIRMADO POR:

VISADO POR: