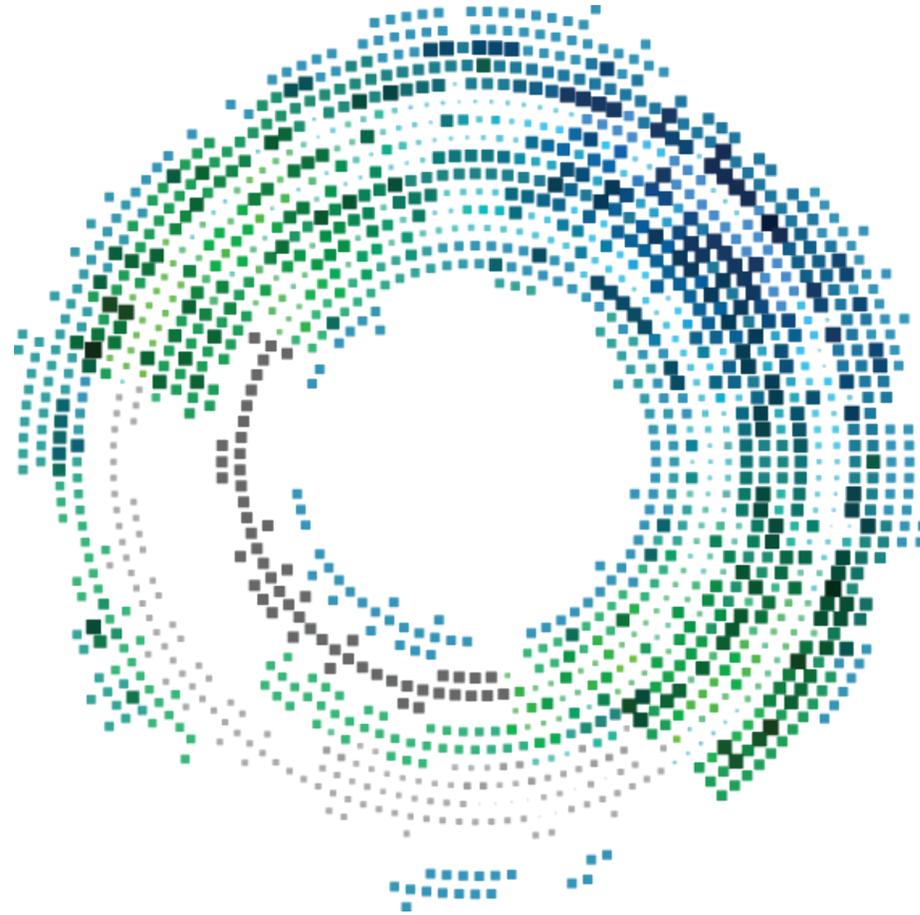


Deloitte.



Financial Engineering & Modelling

Financial Advisory

Financial Engineering & Modelling (FEM)

Principales servicios

Gestión de Riesgos de Financieros

Servicios enfocados en **empresas** que estén expuestas a riesgos de mercado y en **Bancos** en su gestión de liquidez y riesgo mercado de su Balance.



Asesorías en estrategias de mitigación de riesgos de mercado:

- Exposición a Tasa, moneda e inflación.
- Coberturas con derivados.
- Normativas IAS 39 e IFRS 9.



Asesorías gestión de Balance en Bancos:

- Soluciones para la gestión de Balance ALM.
- Coberturas contables complejas.
- Implementación Soluciones ALM.



Asesorías en medición y modelación de riesgo mercado y liquidez (Bancos):

- Desarrollo y validación de modelos de liquidez.
- Medidas cuantitativas de Riesgo Mercado - VAR, EAR y CFaR.
- Normas de Basilea, FRTB, IRRBB.

Riesgo Crédito

Servicios enfocados en **Bancos, Cooperativas y empresas del Retail**, con grandes volúmenes en su carteras de activos (Colocaciones).



Desarrollo y validación de **Modelos de provisiones pérdida esperada** bajo **SBIF** modelos internos.



Desarrollo y validación de **Modelos de provisiones IFRS 9**.



Desarrollo y validación de **Modelos de Scoring admisión, seguimiento, recovery**.



Modelos de stresstest y macroeconómicos para Riesgo Crédito.



Modelos de Riesgo crédito (Rating) y contraparte Bonos, Renta fijas, inversión.



Optimización de líneas proyección de RAROC/RORAC a través de CLV.

Valuación y reportes normativos

Servicios enfocados en **Empresas con instrumentos financieros sofisticados** que requieran valuación, AGFs y Asset Managers (GIPS), y empresas que reportan derivados a **SII y BCCH**.



Servicios de valuación:

- Pricing cartera derivados
- Otros instrumentos complejos
- IFRS 9 / IFRS 13.



Asesoría en metodologías de ajuste MTM:

- CVA, DVA, XVA.



Asesoría en reportes normativos de derivados:

- Banco Central.
- SII.



Certificación GIPS performance examination.



Diseño de modelos FTP/precio transferencia.



Finance Analytics.

Capital y Solvencia / Modelos integrales

Servicios enfocados en Bancos y Cías. de Seguros que requieren desarrollar de metodologías y modelos cuantitativos/herramientas.



Model Risk Management (MRM).



Modelos Internos de Cálculo y optimización de Capital, Solvency y Orsa (Capital económico Raroc y Pricing).



Stresstesting por riesgo e integrales - Mercado - liquidez - crédito - operacional.



Modelos de riesgo operacional (AMA).



Modelos estadísticos, econométricos y de machine Learning para gestión actuariales y/o de riesgo.



Eric Duarte

Rosario Norte 407
Las Condes, Santiago
Chile

eduarter@deloitte.com

Javier Rojas

Rosario Norte 407
Las Condes, Santiago
Chile

javrojas@deloitte.com

Fernando Calderón

Rosario Norte 407
Las Condes, Santiago
Chile

fcalderon@deloitte.com

Deloitte presta servicios profesionales de auditoría, impuestos, consultoría y asesoría financiera, a organizaciones públicas y privadas de diversas industrias. Con una red global de firmas miembro en cerca de 164 países, Deloitte brinda su experiencia y profesionalismo de clase mundial para ayudar a que sus clientes alcancen el éxito desde cualquier lugar del mundo en donde operen. Los aproximadamente 200.000 profesionales de la firma están comprometidos con la visión de ser el modelo de excelencia.

Esta publicación sólo contiene información general y ni Deloitte Touche Tohmatsu Limited, ni sus firmas miembro, ni ninguna de sus respectivas afiliadas (en conjunto la "Red Deloitte"), presta asesoría o servicios por medio de esta publicación. Antes de tomar cualquier decisión o medida que pueda afectar sus finanzas o negocio, debe consultar a un asesor profesional calificado. Ninguna entidad de la Red Deloitte será responsable de alguna pérdida sufrida por alguna persona que utilice esta publicación.

Deloitte © se refiere a Deloitte Touche Tohmatsu Limited, una compañía privada limitada por garantía, de Reino Unido, y a su red de firmas miembro, cada una de las cuales es una entidad legal separada e independiente. Por favor, vea en www.deloitte.cl/acercade la descripción detallada de la estructura legal de Deloitte Touche Tohmatsu Limited y sus firmas miembro.

Deloitte Touche Tohmatsu Limited es una compañía privada limitada por garantía constituida en Inglaterra & Gales bajo el número 07271800, y su domicilio registrado: Hill House, 1 Little New Street, London, EC4A 3TR, Reino Unido.

Oficina central

Rosario Norte 407
Las Condes, Santiago
Chile
Fono: (56) 227 297 000
Fax: (56) 223 749 177
deloittechile@deloitte.com

Regiones

Simón Bolívar 202
Oficina 203
Iquique
Chile
Fono: (56) 572 546 591
Fax: (56) 572 546 595
iquique@deloitte.com

Av. Grecia 860
Piso 3
Antofagasta
Chile
Fono: (56) 552 449 660
Fax: (56) 552 449 662
antofagasta@deloitte.com

Los Carrera 831
Oficina 501
Copiapó
Chile
Fono: (56) 522 524 991
Fax: (56) 522 524 995
copiapo@deloitte.com

Alvares 646
Oficina 906
Viña del Mar
Chile
Fono: (56) 322 882 026
Fax: (56) 322 975 625
vregionchile@deloitte.com

Chacabuco 485
Piso 7
Concepción
Chile
Fono: (56) 412 914 055
Fax: (56) 412 914 066
concepcionchile@deloitte.com

Quillota 175
Oficina 1107
Puerto Montt
Chile
Fono: (56) 652 268 600
Fax: (56) 652 288 600
puertomontt@deloitte.com