

Stress Testing y Planificación de capital



Aprende a medir, modelar y planificar la resiliencia financiera de manera efectiva y práctica.

El programa de Stress Testing y Gestión de Capital ofrece un enfoque integral sobre cómo las entidades financieras pueden evaluar su resiliencia ante escenarios extremos y planificar su capital de manera eficiente. Combina la perspectiva regulatoria del Comité de Supervisión Bancaria de Basilea con metodologías cuantitativas y herramientas prácticas para la predicción de pérdidas, segmentación de riesgo y modelado avanzado.



DURACIÓN
2 meses



MODALIDAD
Híbrida



ENFOQUE
100% práctico



DEDICACIÓN
25h

Programa

- 1.Principios de Stress Testing del Comité de Supervisión Bancaria de Basilea
- 2.Stress Testing y su integración en la gestión estratégica de la entidad
- 3.El proceso de stress testing global de solvencia en una entidad financiera
- 4.El stress testing como herramienta de supervisión
- 5.Métodos y Modelos del Stress Test
- 6.El contexto regulatorio de los modelos de crédito
- 7.Cuantificación de los parámetros de riesgo de crédito, Segmentación
- 8.Modelos de predicción condicionada
- 9.LGD y Low Default
- 10.Planificación de capital
- 11.Pilar II: Examen Supervisor
- 12.Autoevaluación de Capital