

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