

# STRESS TESTING Y PLANIFICACIÓN DE CAPITAL

Caso práctico: **Planificación capital y estrés de capital en una entidad**

CURSO



**DURACIÓN**

1 mes



**MODALIDAD**

Sincrónica y Asincrónica



**ENFOQUE PRÁCTICO**

Conceptos de gestión en situaciones reales



**DEDICACIÓN**

25h

## OBEJTIVOS

En el programa se exponen metodologías de estrés de capital que permiten hacer una evaluación integral de los riesgos y medir la solvencia de las entidades, para determinar posibles exigencias de capital en caso de ser necesarias.

Se exponen nuevas metodologías de stress testing en los riesgos de crédito, se aborda de forma especial el stress testing para carteras de crédito de consumo y corporativos, particularmente aplicado a la PD, LGD, EAD, y dotaciones del IFRS 9.

## PROGRAMA

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



+34 918599010



info@nemesisrisk.com



WWW.NEMESISRISK.COM