

MODELOS PREDICTIVOS DE CRÉDITO, MERCADO, LIQUIDEZ Y OPERACIONAL

Desarrolla las capacidades necesarias para destacar en tu carrera y lidera con confianza en un entorno altamente competitivo

SEMINARIO



DURACIÓN
2/3 días



MODALIDAD
Sincrónica



ENFOQUE PRÁCTICO
Conceptos de gestión en situaciones reales



DEDICACIÓN
6h

OBEJTIVOS

Aprende sobre la nueva gestión del riesgo de crédito avanzada frente al nuevo modelo tradicional. Lo que se persigue es optimizar la relación riesgo/rentabilidad y para ello es necesario evolucionar desde la gestión del riesgo individual de una transacción hacia la gestión de cartera y la gestión global de los riesgos (enfoque más amplio).

PROGRAMA

- Teoría Riesgo de Mercado y Contrapartida (Var, Expected Shortfall, Backtesting).
- Contexto de Mercado actual en la crisis del Coronavirus para los principales activos cotizados.
- Teoría Riesgo de Liquidez y Financiación (Métricas, Plan de contingencia de Liquidez, el papel del COAP).
- Contexto de liquidez actual en la crisis del Coronavirus. Ejemplo práctico de cálculo de ratios LCR y NSFR.
- Teoría Riesgo Operacional y Reputacional (Gestión Cualitativa y Gestión Cuantitativa. Riesgo Reputacional).
- Ejemplos de Responsabilidad Social Corporativa.

Se requiere un mínimo de participantes



+34 918599010



info@nemesisrisk.com



WWW.NEMESISRISK.COM