

AUTOEVALUACIÓN DE CAPITAL ICAAP Y GESTIÓN DE RIESGOS

NIVEL INTERMEDIO

OBJETIVOS

- Adquirir un conocimiento integral de las etapas clave del Proceso ICAAP, desde la evaluación cuantitativa y cualitativa de riesgos hasta la elaboración del informe final
- Desarrollar competencias para analizar riesgos estáticos y dinámicos mediante escenarios adversos
- Fortalecer la capacidad de los participantes para interpretar y aplicar las mejores prácticas internacionales en la evaluación de suficiencia de capital, alineadas con las exigencias regulatorias y las dinámicas del mercado financiero.

EQUIPO DOCENTE



Profesor Universitario. Ex Responsable de Capital Adequacy y Economic Capital en Santander

Profesional con amplia experiencia (30 años) en gestión global de riesgo, regulación financiera y capital en Bankia y Santander. Economista y Master en Dirección y Gestión Bancaria. Director de Gestión Global de Riesgo en Bankia (2016-2018)

CONTENIDO

Autoevaluación de Capital ICCAP

- Nivel : **Intermedio**
- Días: **02 julio 2025**
- Horario: Mañana Latam
- Duración: 1 mes
- Metodología: Campus y sesiones en directo
- Plataforma: Zoom/Teams

TEMARIO

1. Tipos de riesgo en el sector bancario
2. El enfoque ERM de gestión global del riesgo
 - 2.1. Necesidad de una gestión global del riesgo
 - 2.2. Aspectos comunes esenciales en los enfoques ERM de gestión global del riesgo
 - 2.3. Impulso regulatorio al enfoque ERM de gestión global del riesgo
3. La Gran Crisis Financiera de 2008
4. Gobierno interno
 - 4.1. Pobre gobierno de riesgos durante la Crisis Financiera
 - 4.2. Responsabilidades del Consejo
5. Marco de Apetito a Riesgo
 - 5.3. Marco y declaración
6. Stress testing
 - 6.1. Tipos de stress testing y análisis de escenarios
 - 6.2. Stress Testing: asegurar que el Plan de Negocio cumple con el Apetito
7. El proceso ICAAP
 - 7.1 Aspectos Cualitativos
 - 7.2 Cuantificación Riesgos y Suficiencia Capital (visión estática)
 - 7.3 Planificación de Capital y Stress Test (visión dinámica)
 - 7.4 Conclusiones adecuación capital
8. Riesgo y Capital. Capital Económico
 - 8.1. Riesgo y Capital
 - 8.2. Capital Económico
9. Rentabilidad ajustada a riesgo