

Compendio de Normas que regulan a las Cajas de Compensación de Asignación Familiar

/ 6 LIBRO VI. GESTIÓN DE RIESGOS / 6.3 TÍTULO III. RIESGO DE LIQUIDEZ / 6.3.7 TEST DE ESTRÉS / 6.3.7.2 Aspectos mínimos a considerar

6.3.7.2 Aspectos mínimos a considerar

El Test de Estrés debe contener a lo menos los siguientes elementos:

- a) Descripción detallada de cada escenario indicando la relevancia en la medición de la liquidez de la Caja.
 - b) Identificación de las variables estresadas en cada escenario, considerando la magnitud de la perturbación aplicada en cada banda temporal.
 - c) Cuantificación del impacto de cada escenario sobre las brechas de liquidez de cada uno de los horizontes temporales.
 - d) Conclusión de los resultados obtenidos para cada escenario, y las medidas de mitigación asociadas si corresponde.
 - e) Anexo metodológico donde se presenta el modelo de liquidez base y el modelo de liquidez con las partidas modificadas para cada escenario.
-