

Riesgo Operacional (RO)

Fundamentos para la administración RO

El curso está dirigido a profesionales cuyo ejercicio esté relacionado con la administración de riesgos (en el sector financiero o la academia) y gerentes o responsables de procesos o funciones que deseen administrar los riesgos inherentes a las tareas que supervisan.

TEMAS

- | | |
|--|--|
| 1.- Antecedentes | 1.1.- Análisis de casos Pérdidas catastróficas por riesgo operacional 1.2.- Evolución de la regulación internacional sobre riesgo operacional |
| 2.- Definición, objetivos y estructura | 2.1.- Definición y clasificación de riesgos financieros 2.2.- Objetivos de la administración de riesgo operacional 2.3.- Clasificación de riesgos operacionales y de eventos de pérdida 2.4.- Ciclo de gestión de riesgos operacionales 2.5.- El modelo de 3 líneas de defensa vs. riesgos operacionales 2.6.- Estructura organizacional para la gestión del riesgo operacional |
| 3.- Marco normativo internacional | 3.1.- Acuerdo de Basilea II, sus tres pilares 3.2.- Cálculo de capital por riesgo operacional (Básico, Estándar, Avanzada) 3.3.- Regulación sobre la administración del riesgo operacional - Solvencia II |
| 4.- Identificación de riesgos operacionales | 4.1.- Caracterización de riesgos operacionales por frecuencia y severidad 4.2.- Construcción de la matriz de riesgos operacionales (inherente, control, residual) 4.3.- Análisis de escenarios 4.4.- Autoevaluación del entorno y del control interno (cuestionarios, entrevistas y talleres) 4.5.- Estadísticas de pérdidas 4.6.- Información interna y externa |
| 5.- Base de datos e informes RO | 5.1.- Incidentes de riesgo operacional (responsables e información a registrar) 5.2.- Aplicaciones e inconvenientes de la base de datos |
| 6.- Scorecard de Riesgo Operacional | 6.1.- KRI RO: ¿Qué es? y ¿cuál es su utilidad? 6.2.- Ejemplos de KRI RO 6.3.- Fuentes de información para el seguimiento de KRI 6.4.- Niveles de tolerancia al riesgo operacional 6.5.- Definición y clasificación de niveles de tolerancia 6.6.- Determinación y seguimiento a niveles de tolerancia |
| 7.- Desarrollo de planes de mitigación/control | 7.1.- Análisis costo/beneficio 7.2.- Alternativas para la mitigación y control de riesgos |
| 8.- Cuantificación monetaria de la exposición a RO | 8.1.- Frecuencia y severidad de los eventos de pérdida 8.2.- Cuantificación de la exposición global de RO 8.3.- EL RO, UL RO, VaR RO, Estructura de correlaciones |

Curso 100% Práctico con MS Excel



Docente



Actuario por la UNAM de México y con maestría en ciencias por el Imperial College of Science Technology and Medicine. Socio fundador de Numeravi Valuación y Análisis de Riesgos (México), experto con mas de 20 años de experiencia desarrollando e implementando modelos de riesgo de crédito, mercado y operacional (marcos normativos de Basilea y Solvencia). Asimismo, cuenta con experiencia docente (profesor de la maestría en Finanzas en la UNAM de México).

