



SEMINARIO - TALLER INTERNACIONAL

Gestión del Riesgo Operacional:

Desarrollo de Herramientas
para la Gestión Estratégica

📍 Lima, Perú

📅 25 al 28 de setiembre de 2018

ALIDE  50 AÑOS



OBJETIVOS

Proporcionar a los participantes de instrumentos teóricos y prácticos que permitan una adecuada identificación, administración y control de riesgo operativo en observancia con las mejores prácticas y procedimientos.

Adicionalmente, como objetivos específicos el Seminario – Taller pretende:

- ◆ Interiorizar la relevancia del análisis de procesos, ambientes de controles y metodologías para el cumplimiento de objetivos organizacionales.
- ◆ Revisar los temas vinculados al riesgo operativo como gobierno corporativo como puntos complementarios a la gestión de personas, procesos, sistemas y eventos externos.
- ◆ Identificar las implicancias de la gestión de riesgo como parte integrante de la gestión corporativa de riesgos.
- ◆ Manejo de herramientas cuantitativas y cualitativas para la gestión y control del riesgo operacional.

ENFOQUE DIDÁCTICO

El Seminario - Taller considera la transmisión de conocimientos en base a una combinación de: (1) exposiciones en las que se tratarán los aspectos conceptuales y normativos del riesgo operativo, (2) la presentación de casos prácticos de identificación, gestión, control y supervisión de riesgo operativo y (3) ejercicios que se desarrollarán en un taller en equipos de trabajo referidos a la generación de mapas de riesgo, autoevaluación, identificación de riesgo operativo por frecuencia e impacto.

LUGAR, FECHA Y HORARIO

El Seminario - Taller internacional se llevará a cabo en la ciudad de Lima, Perú, **del martes 25 al viernes 28 de setiembre de 2018.** Las sesiones de trabajo se desarrollarán en el horario de 9:00 a 17:30 horas, en la sede de ALIDE, localizado en: Av. Paseo de la República 3211, San Isidro, Lima, Teléfono: +511 203-5520.

PROGRAMA TEMÁTICO

PARTE I

MARCO DE GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

- ◆ Lineamientos estratégicos.
- ◆ Gobernanza del riesgo operacional.
- ◆ Definición de apetito al riesgo.
- ◆ Líneas de defensa del riesgo operacional.
- ◆ La relevancia de los responsables de riesgos y los dueños de procesos.
- ◆ Casos prácticos.

PARTE II

DISEÑO DE MATRIZ E INDICADORES PARA LA GESTIÓN Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL

- ◆ Frecuencia e impacto.
- ◆ Incidencias.
- ◆ Eventos “cisne negro”.
- ◆ Diseño de la matriz de riesgo operacional.
- ◆ Generación de indicadores de gestión o desempeño, de riesgo operacional y de control.
- ◆ Selección de indicadores preventivos de riesgo operacional.

TALLER 1: Desarrollo de matriz de riesgo, identificación de principales indicadores.

PARTE III

RIESGO OPERACIONAL: IMPLICANCIAS EN EL PROCESO COMERCIAL, PRODUCTOS, INFORMACIÓN Y CONTRATOS

- ◆ Proceso comercial.
 - Pre evaluación.
 - Análisis.
 - Desembolso.
 - Gestión y seguimiento.
 - Vencimiento.
 - Recuperación.
- ◆ Riesgo operacional y productos.
 - Conceptos a analizar.
 - Mecanismo de evaluación.
- ◆ Tecnología de Información.
 - Seguridad de Información.
 - Tipo de información.
 - Mecanismos de gestión y control.
- ◆ Riesgo operacional y tercerización.
 - Contratos con proveedores.
 - Modelo de contrato.
 - Mecanismos de gestión y control.

PARTE IV

CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL

- ◆ Determinación de controles.
- ◆ Importancia del control preventivo.
- ◆ Relación del riesgo operacional con auditoría interna y cumplimiento.
- ◆ COSO.
- ◆ Matriz de riesgo operacional residual o marginal.
- ◆ Casos prácticos.

TALLER 2: Matriz de riesgo e indicadores de desempeño, riesgo operacional y control para procesos y recursos humanos.

PARTE V

HERRAMIENTAS CUALITATIVAS PARA LA GESTIÓN Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL

- ◆ Método Bow Tie.
- ◆ Herramienta de criticidad de procesos.
- ◆ Herramienta de autoevaluación.
- ◆ Herramienta de recolección de eventos de pérdida.
- ◆ Herramienta de eficacia de controles.
- ◆ Herramienta de gestión: indicadores de desempeño, riesgo y control.

PARTE VI

HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO OPERACIONAL

- ◆ Funciones de distribución, variables aleatorias, condicionalidad.
- ◆ Del enfoque básico al avanzado.

TALLER 3: Asignación de capital regulatorio.

PRESENTACIÓN DE TRABAJOS DEL TALLER CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES



EXPOSITOR

Econ. ROBERTO KEIL MONTOYA



Peruano, Licenciado en Economía y Master en Economía con mención en Banca y Finanzas por la Universidad de Lima (Perú), miembro de The Professional Risk Managers International Association y de Global Association of Risk Professionals. Es Presidente de Directorio y del Comité de Clasificación de Accuratio Credit Rating Agency Clasificadora de Riesgo S.A. en Perú desde enero de 2016, empresa que cuenta con la participación de JCR Japón, quinta calificadora de riesgo a nivel internacional. Realiza labores de consultoría en materia de Basilea II, gobierno corporativo, cumplimiento y aplicación de mejores prácticas en dirección y gestión de empresas. Es Expositor de ALIDE para temas de riesgos financieros, gobierno corporativo y cumplimiento, y en asociaciones de bancos, revistas especializadas, bancos y organismos internacionales.

PARTICIPANTES

Responsables de las áreas de riesgos, auditoría y planeamiento de bancos comerciales, bancos de desarrollo, instituciones financieras no bancarias, organismos de supervisión bancaria y consultores financieros además de todos aquellos profesionales relacionados en el área, que tengan bajo su responsabilidad las áreas siguientes:

- ◆ Gerentes de áreas operativas, recursos humanos, control y capacitación de personal, funcionarios del departamento operativo y de auditoría, departamento de tecnología, personal encargado de controlar la eficiencia y buen desempeño del personal bancario a nivel general.
- ◆ Área de riesgos financieros, que tengan como objetivo la medición, control y gestión del riesgo integral que comprende los siguientes tipos: riesgo de mercado y liquidez, riesgo operativo, riesgo de crédito y riesgo legal.



INVERSIÓN

Los derechos de inscripción para el Seminario – Taller, que considera los costos de matrícula, materiales didácticos, certificado, refrigerios, almuerzos y demás facilidades del entrenamiento, son los siguientes:

- ◆ **US\$800** por participante (institución peruana)
- ◆ **US\$950** por participante (institución de otros países, miembro de ALIDE)
- ◆ **US\$1,100** por participante (institución de otros países, no miembro de ALIDE)

El importe de las inscripciones es neto sin afectar deducciones o impuestos. Por lo tanto, si se va a aplicar deducciones o impuestos al importe neto de la inscripción, debe comunicarse a ALIDE el porcentaje a aplicar, con el fin de emitir la factura por un monto tal que permita cobrar la cuota de inscripción estipulada.

El importe de la inscripción podrá ser abonado según las opciones siguientes:

◆ **Depósito o transferencia bancaria:**

Para instituciones en el Perú: Cta. Cte. N° 193-1132251188 del Banco de Crédito del Perú

Para instituciones de otros países: Transferencia bancaria a la cuenta corriente de ALIDE N° 75022011-3 del Banco do Brasil S.A. (New York). Dirección: 535 Madison Avenue – 34th floor, New York NY 10022, U.S.A.,
Tel. +1-646 845-3700. ABA: 026003557. SWIFT: BRASUS33.

◆ **En efectivo**, al momento del registro de participantes, en la sede del seminario seminario - taller.

Los gastos que ocasione la participación de representantes no residentes en la ciudad de Lima, tales como pasajes aéreos y manutención durante el seminario, deberán ser asumidos por las instituciones patrocinadoras y/o por los propios interesados.



ALOJAMIENTO

Se ha negociado **tarifas preferenciales** para hospedarse en el siguiente hotel:

HOTEL FOUR POINTS BY SHERATON MIRAFLORES ★★★★★

Dirección: Calle Alcanfores 290, Miraflores

Teléfono: +511 206-1100

WebSite: www.starwoodhotels.com/fourpoints/

Tarifas: Habitación clásica Simple: US\$125.00
+ 10 % de impuestos
Habitación clásica Doble: US\$135.00
+ 10 % de impuestos

Observaciones: Las tarifas están exentas del pago de IVA para no residentes en Perú, presentando su documentación al momento del Check In. Las tarifas incluyen desayuno buffete Acceso a Internet en todas las instalaciones del hotel. Check in: 15:00 hrs. / Check out: 12:00 hrs.

Contacto: Elvia Eduardo, Asistente de Reservas,
Tel: +511 206-1100 Ext. 2002

E-mail: reservas1@fourpointsmiraflores.com
vfigueroa@toprankhotel.com

Las solicitudes de reservación de alojamiento deben ser realizadas directamente por las instituciones patrocinadoras o los participantes al Hotel Four Points by Sheraton Miraflores, indicando que es participante del Seminario de ALIDE para acceder a la tarifa preferencial.

Se recomienda efectuar esta solicitud a la mayor brevedad y a más tardar hasta el **martes 18 de setiembre**, que será la fecha límite para asegurar la reservación de alojamiento. Luego de esa fecha, las habitaciones serán asignadas a disponibilidad del hotel.



**Hotel
Four Points
By Sheraton
Miraflores**





CIUDAD Y CLIMA

La ciudad de Lima, capital de la República del Perú, fue fundada el 18 de enero de 1535 y tiene una población estimada de más de 9 millones de habitantes. Se encuentra situada en la costa, a 154 metros sobre el nivel del mar y tiene un clima templado, sin grandes lluvias en el invierno ni excesivo calor en el verano. Durante el mes de setiembre es primavera, con temperaturas que oscilan entre 15 y 19°C grados y con una humedad del 80%, motivo por el cual la sensación térmica puede ser entre 2 y 4°C menos, por lo que se sugiere traer ligera para el día y ropa abrigadora para la noche. En cuanto a la vestimenta para el seminario se recomienda usar ropa formal para la inauguración y casual para el desarrollo de las actividades del evento.

MATERIAL DE ESTUDIO

Los participantes recibirán los materiales de estudio del seminario y otros documentos de consulta de manera electrónica.

CERTIFICACIÓN INTERNACIONAL

ALIDE otorgará **Certificación Internacional** a los participantes que cumplan con: (a) 90% de asistencia puntual a las sesiones y (b) participen activamente en el Seminario.



ALIDE 50 AÑOS

INFORMES E INSCRIPCIONES

Para las inscripciones y confirmaciones de participación en el seminario, los interesados deben llenar la ficha de inscripción que se adjunta y remitirla, a más tardar el martes 18 de setiembre de 2018, a:

Benjamin Carbajal

Programa de Capacitación y Cooperación

Teléfono: +511 203-5520 Ext. 208

Correo: bcarbajal@alide.org

**ASOCIACIÓN LATINOAMERICANA DE INSTITUCIONES
FINANCIERAS PARA EL DESARROLLO (ALIDE)**

Paseo de la República 3211. San Isidro. Lima 27

Apartado postal 3988, Lima 100 – Perú

Web: www.alide.org