



ASOCIACIÓN LATINOAMERICANA DE INSTITUCIONES FINANCIERAS  
PARA EL DESARROLLO (ALIDE)

Seminario - Taller Internacional  
**GESTIÓN DEL RIESGO OPERACIONAL:**  
**Desarrollo de Herramientas para la Gestión Estratégica**  
Lima, Perú, 25 al 28 de setiembre de 2018

Programa Preliminar de Actividades

Martes, 25 de setiembre de 2018

8:30 a 9:00 horas	Registro de participantes
9:00 a 9:30 horas	<u>Inauguración</u>
9:30 a 11:00 horas	<u>PARTE I: MARCO DE GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL</u> <ul style="list-style-type: none"><li>➤ Lineamientos estratégicos</li><li>➤ Gobernanza del riesgo operacional</li><li>➤ Definición de apetito al riesgo</li></ul>
11:00 a 11:30 horas	Receso para café
11:30 a 13:30 horas	<ul style="list-style-type: none"><li>➤ Líneas de defensa del riesgo operacional</li><li>➤ La relevancia de los responsables de riesgos y los dueños de procesos</li><li>➤ Casos prácticos</li></ul>
13:30 a 14:30 horas	Almuerzo
14:30 a 16:00 horas	<u>PARTE II: DISEÑO DE MATRIZ E INDICADORES PARA LA GESTIÓN Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL</u> <ul style="list-style-type: none"><li>➤ Frecuencia e impacto</li><li>➤ Incidencias</li><li>➤ Eventos "cisne negro"</li><li>➤ Diseño de la matriz de riesgo operacional</li><li>➤ Generación de indicadores de gestión o desempeño, de riesgo operacional y de control</li></ul>

- Selección de indicadores preventivos de riesgo operacional
- 16:00 a 16:15 horas      Receso para café
- 16:15 a 17:30 horas      **TALLER 1:** Desarrollo de matriz de riesgo, identificación de principales indicadores

**Miércoles, 26 de setiembre de 2018**

9:00 a 11:00 horas      **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
- 11:00 a 11:30 horas      Receso para café
- 11:30 a 13:30 horas      ➤ 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

13:30 a 14:30 horas      Almuerzo

14:30 a 16:00 horas      **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

16:00 a 16:15 horas	Receso para café
16:15 a 17:30 horas	<b>TALLER 2:</b> Matriz de riesgo e indicadores de desempeño, riesgo operacional y control para procesos y recursos humanos

### **Jueves, 27 de setiembre de 2018**

9:00 a 11:00 horas	<b><u>PARTE V: HERRAMIENTAS CUALITATIVAS PARA LA GESTION Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL</u></b>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>➤ Método Bow Tie</li> <li>➤ Herramienta de criticidad de procesos</li> <li>➤ Herramienta de autoevaluación</li> </ul>
11:00 a 11:30 horas	Receso para café
11:30 a 13:30 horas	<ul style="list-style-type: none"> <li>➤ Herramienta de recolección de eventos de pérdida</li> <li>➤ Herramienta de eficacia de controles</li> <li>➤ Herramienta de gestión: indicadores de desempeño, riesgo y control</li> </ul>
13:30 a 14:30 horas	Almuerzo
14:30 a 16:00 horas	<b><u>PARTE VI: HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA LA GESTION DEL RIESGO OPERACIONAL</u></b>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>➤ Funciones de distribución, variables aleatorias, condicionalidad</li> <li>➤ Del enfoque básico al avanzado</li> </ul>
16:00 a 16:15 horas	Receso para café
16:15 a 17:30 horas	<b><u>TALLER 3:</u></b> Asignación de capital regulatorio

### **Viernes, 28 de setiembre de 2018**

9:00 a 11:00 horas	<b>PRESENTACIÓN DE TRABAJOS DEL TALLER</b>
11:00 a 11:30 horas	Receso para café
11:30 a 12:30 horas	<b>CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES</b>
12:30 a 12:45 horas	Evaluación
12:45 a 13:00 horas	<b><u>Clausura y entrega de certificados</u></b>