



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">➤ Lineamientos estratégicos➤ Gobernanza del riesgo operacional➤ Definición de apetito al riesgo |
| 11:00 a 11:30 horas | Receso para café |
| 11:30 a 13:30 horas | <ul style="list-style-type: none">➤ Líneas de defensa del riesgo operacional➤ La relevancia de los responsables de riesgos y los dueños de procesos➤ Casos prácticos |
| 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">➤ 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
- 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	TALLER 2: 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	<u>PARTE V: HERRAMIENTAS CUALITATIVAS PARA LA GESTION Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL</u>
	<ul style="list-style-type: none"> ➤ Método Bow Tie ➤ Herramienta de criticidad de procesos ➤ Herramienta de autoevaluación
11:00 a 11:30 horas	Receso para café
11:30 a 13:30 horas	<ul style="list-style-type: none"> ➤ Herramienta de recolección de eventos de pérdida ➤ Herramienta de eficacia de controles ➤ Herramienta de gestión: indicadores de desempeño, riesgo y control
13:30 a 14:30 horas	Almuerzo
14:30 a 16:00 horas	<u>PARTE VI: HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA LA GESTION DEL RIESGO OPERACIONAL</u>
	<ul style="list-style-type: none"> ➤ Funciones de distribución, variables aleatorias, condicionalidad ➤ Del enfoque básico al avanzado
16:00 a 16:15 horas	Receso para café
16:15 a 17:30 horas	<u>TALLER 3:</u> Asignación de capital regulatorio

Viernes, 28 de setiembre de 2018

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