

GRUPO QUANTS

ESPECIALIZACIÓN EN

CURSO INTEGRAL DE RIESGO OPERACIONAL: FUNDAMENTOS Y GESTIÓN AVANZADA



DURACIÓN: 30 HORAS

ESPECIALIZACIÓN EN

CURSO INTEGRAL DE RIESGO OPERACIONAL: FUNDAMENTOS Y GESTIÓN AVANZADA

Modulo 1: Fundamentos

Antecedentes

Definición, objetivos y estructura

Marco normativo internacional

**Identificación de
riesgos operacionales**

Base de datos e informes RO

Scorecard de Riesgo Operacional

**Desarrollo de planes de
mitigación/control**

**Cuantificación monetaria
de la exposición a RO**

Modulo 2: Medicion Avanzada

**Enfoques de instrumentación
de los Modelos de Medición
Avanzada.**

**Componentes de un sistema de
medición avanzada del
riesgo operativo**

**Enfoque Scorecard para la
medición del riesgo operativo**

Modelos Estadísticos

**Distribuciones de probabilidad de
valores extremos aplicada a la
medición del riesgo operativo**

MALLA CURRICULAR

MODULO 1: FUNDAMENTOS



MODULO 2: MEDICION AVANZADA



MALLA CURRICULAR

MODULO 1: FUNDAMENTOS



ANTECEDENTES

- Análisis de casos Pérdidas catastróficas por riesgo operacional
- Evolución de la regulación internacional sobre riesgo operacional



DEFINICIÓN, OBJETIVOS Y ESTRUCTURA

- Definición y clasificación de riesgos financieros
- Objetivos de la administración de riesgo operacional
- Clasificación de riesgos operacionales y de eventos de pérdida
- Ciclo de gestión de riesgos operacionales
- El modelo de 3 líneas de defensa vs. riesgos operacionales
- Estructura organizacional para la gestión del riesgo operacional



MARCO NORMATIVO INTERNACIONAL

- Acuerdo de Basilea II, sus tres pilares
- Cálculo de capital por riesgo operacional (Básico, Estándar, Avanzada)
- Regulación sobre la administración del riesgo operacional - Solvencia II



IDENTIFICACIÓN DE RIESGOS OPERACIONALES

- Caracterización de riesgos operacionales por frecuencia y severidad
- Construcción de la matriz de riesgos operacionales (inherente, control, residual)
- Análisis de escenarios
- Autoevaluación del entorno y del control interno (cuestionarios, entrevistas y talleres)
- Estadísticas de pérdidas
- Información interna y externa

MALLA CURRICULAR



BASE DE DATOS E INFORMES RO

- Incidentes de riesgo operacional (responsables e información a registrar)
- Aplicaciones e inconvenientes de la base de datos



SCORECARD DE RIESGO OPERACIONAL

- KRI RO: ¿Qué es? y ¿cuál es su utilidad?
- Ejemplos de KRI RO
- Fuentes de información para el seguimiento de KRI
- Niveles de tolerancia al riesgo operacional
- Definición y clasificación de niveles de tolerancia
- Determinación y seguimiento a niveles de tolerancia



DESARROLLO DE PLANES DE MITIGACIÓN/CONTROL

- Análisis costo/beneficio
- Alternativas para la mitigación y control de riesgos



CUANTIFICACIÓN MONETARIA DE LA EXPOSICIÓN A RO

- Frecuencia y severidad de los eventos de pérdida
- Cuantificación de la exposición global de RO
- EL RO, UL RO, VaR RO, Estructura de correlaciones

MALLA CURRICULAR

MODULO 2: MEDICION AVANZADA



ENFOQUES DE INSTRUMENTACIÓN DE LOS MODELOS DE MEDICIÓN AVANZADA.

- Scorecards
- Medición interna
- Modelos estadísticos



COMPONENTES DE UN SISTEMA DE MEDICIÓN AVANZADA DEL RIESGO OPERATIVO

- Autoevaluación del entorno y del control interno
- Análisis de escenarios
- Estadísticas internas de pérdida por riesgo operativo
- Estadísticas externas de pérdida por riesgo operativo



ENFOQUE SCORECARD PARA LA MEDICIÓN DEL RIESGO OPERATIVO

- Definición y características de los indicadores clave de riesgo
- Descripción de la metodología
- Mapeo de riesgos
- Scorecard - Definición de umbrales y límites
- Score de actividades y líneas de negocio
- Cálculo del requerimiento de capital



DISTRIBUCIONES DE PROBABILIDAD DE VALORES EXTREMOS APLICADA A LA MEDICIÓN DEL RIESGO OPERATIVO

- Introducción a la teoría de valores extremos
- Distribución de valores extremos (GEV)
 - Estimación por máxima verosimilitud
 - Estimación por momentos ponderados
- Distribuciones de Pareto Generalizada (GPD)
 - Estimación por máxima verosimilitud
 - Estimación por momentos ponderados
- Aplicación a la severidad de las pérdidas
- Ajuste de dos o más distribuciones para la severidad de las pérdidas.



MODELOS ESTADÍSTICOS

- Pérdida esperada y no esperada
- Distribuciones de probabilidad para la frecuencia (Poisson, binomial negativa, binomial, geométrica, otras distribuciones)
- Distribuciones de probabilidad para la severidad (Normal, lognormal, exponencial, Pareto, combinación de distribuciones, otras distribuciones)
- Pruebas a los ajustes de las distribuciones:
 - Pruebas gráficas
 - Pruebas analíticas
- Estimación del Valor en Riesgo Operativo VaR por simulación montecarlo
 - Generación de la distribución de pérdidas anuales por riesgo operativo.
 - Pérdida esperada y no esperada
- Valor en Riesgo Operativo



TRANSFERENCIA BANCARIA

Depósito:
A nombre de Grupo Quants SAC
RUC: 20606014172



Cta Cte en SOLES BCP: 192-8751132-0-71
CCI N°: 00219200875113207132

Cta. Cte. en DOLARES BCP: 192-9405810-1-90
CCI N° 00219200940581019031



Cta de Detracción en SOLES Banco de la Nación
N°: 00-012-059906 (10%)

MEDIOS DE PAGO

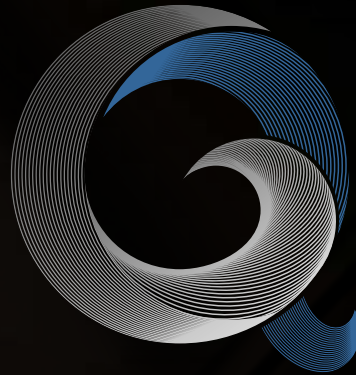


PAGO CON TARJETA DE CRÉDITO




niubiz:





GRUPO QUANTS

MAYOR INFORMACIÓN

 + 51 938 117 737

www.grupoquants.com