



# MÉTODOS CUANTITATIVOS DE RIESGO OPERATIVO

Aplicación de la Resolución N° 2115 de 2009 de la SBS



15 y 16 de Marzo

## Expositor



Nelson Cepeda Espinel  
(Colombia)

Gerente de Riesgos Fiducoldex Colombia. Curso de gestión de riesgos financieros universidad de Columbia University N.Y. Maestría en Finanzas (Universidad Externado en convenio con School of International Public and Affairs – Columbia University N.Y.). Contador Público y Especialista en Finanzas-Banca de Inversión (Universidad Externado de Colombia). Catedrático e Investigador universitario en temas de Finanzas, Banca de Inversión y Riesgos Financieros en programas de postgrado en Finanzas, Ingeniería Financiera y Gestión de Riesgos Financieros en universidades como Externado, Sergio Arboleda, , Andes y Sabana, entre otras. Con más de 15 años de experiencia en dirección de proyectos de auditoría de riegos financieros y consultoría financiera para importantes empresas públicas y privadas en Latinoamérica.

## Dirigido a

Gerentes Generales de Instituciones Financieras, Asesores, Financieros, Auditores, Jefes de Operaciones, Tesoreros, Jefes de Riesgos y Analistas responsables de medir, supervisar, interpretar y reportar riesgos.

Personal de entidades financieras y universidades interesados en conocer a profundidad los fundamentos conceptuales y prácticos del riesgo operativo.


## Objetivo

El objetivo principal de este curso es familiarizar a los asistentes con las diferentes técnicas y métodos cuantitativos que intervienen dentro de la administración del riesgo operativo.

## Requerimientos

A los asistentes, se enfatizará en la cuantificación del riesgo operativo y requerimiento de capital basado en los modelos avanzados de frecuencia-severidad "OPVaR" usando software específico para simular este tipo de eventos RISK SIMULATOR y CRYSTAL BALL.

# Temario

1. **Definiciones y Conceptos Estadísticos Básicos.**
    - 1.1. Introducción
    - 1.2. Funciones de distribución y conceptos relativos
    - 1.3. Momentos estadísticos
    - 1.4. Cuantiles de una distribución
    - 1.5. Variables aleatorias
    - 1.6. Suma de variables aleatorias
    - 1.7. Producto de variables aleatorias
  2. **Distribuciones especiales de probabilidad para variable discreta**
    - 2.1. Distribución Bernoulli, Binomial, Hipergeométrica y otras.
    - 2.2. Distribución Poisson
    - 2.3. Su aplicación a: frecuencia de pérdida
    - 2.4. Distribuciones probabilísticas continuas
    - 2.5. Distribución normal.
    - 2.6. Distribución normal estándar.
    - 2.7. Distribución Log normal, Uniforme, t student, Weibull, Pareto; Exponencial y otras
    - 2.8. Su aplicación a : Severidad de pérdida
  3. **Métodos de estimación BASILEA II – Resolución 2115-2009 de la S.B.S**
    - 3.1. Modelo Básico
    - 3.2. Modelo Estándar
    - 3.3. Modelo Avanzado
  4. **Proceso de administración del riesgo operativo**
    - 4.1. Identificación de riesgos
    - 4.2. Calificación y evaluación de riesgos
    - 4.3. Diseño de controles
    - 4.4. Monitoreo y evaluación de riesgos
    - 4.5. Elaboración de mapas de riesgo
  5. **Riesgo operativo: Modelos Internos**
    - 5.1. Cálculo de frecuencia y severidad de pérdidas por riesgo operativo a partir de la base de datos.
    - 5.2. Cómo conformar bases de datos de eventos de pérdida por riesgo operativo.
    - 5.3. Estimación de costos y pérdidas mensuales por línea de negocio utilizando la base de datos.
    - 5.4. Construcción de indicadores de cumplimiento (scorecards).
    - 5.5. Constitución de provisiones y capital por Riesgo Operativo.
    - 5.6. El rol de auditoría, control interno y oficiales de cumplimiento.
  6. **Aplicación de modelos de simulación “Risk Simulator y Crystal Ball” Para cuantificar el VaR operativo**
    - 6.1. Análisis de modelos de simulación usados en riesgo operativo.
    - 6.2. Identificación de distribuciones de severidad: Weibull, Pareto; Exponencial y otras.
    - 6.3. Identificación de distribuciones de frecuencia: Bernoulli, Binomial, Hipergeométrica y otras.
    - 6.4. Uso de la distrib.Poisson y Log Normal: simulación de Pérdidas Totales.
    - 6.5. Ejemplos con bases de datos reales utilizando paquetes profesionales Risk Simulator y Crystal Ball).
- 

## Fechas y Horarios

**Jueves, 15 de Marzo**  
09:00 a 17:00 horas

**Viernes, 16 de Marzo**  
09:00 a 17:00 horas

## Lugar

**Hotel Britania Miraflores**  
Cl. Independencia 211 - Miraflores  
(Alt. Cdra. 4 Av. 2 de Mayo)

## Costos

**DESCUENTOS POR:**

- Descuento Corporativo (Mínimo 3 personas)
- Descuento por Pago Anticipado\*

**\*Hasta el 02 DE MARZO**

## Pagos

Titular de la cuenta: AMS Consulting S.A.C.  
Banco de la Nación – Cuenta de Detracciones  
Nuevos Soles: N° 00 – 000 – 612480

Banco de la Nación – Cuenta Corriente  
Nuevos Soles: N° 00 – 068 – 092612

Banco Continental – BBVA  
Dólares: N° 0011 – 0191 – 0200111826 – 40  
Nuevos Soles: N° 0011 – 0191 – 0200111818 – 47

## Informes e Inscripciones

Contactos: Flor Rojo / Susana Santos  
Teléfonos: (511) 775 – 8533 / (511) 4641432 anexos 26 - 27  
Telefax: (511) 4641839  
E-mail: [contacto@igsglobal.org](mailto:contacto@igsglobal.org)  
[contactoigs@gmail.com](mailto:contactoigs@gmail.com)