



IMF CONSULTING SAC  
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

## RISK-07: GESTION DEL RIESGO OPERACIONAL, APLICACIÓN DEL COSO ERM Y ESTANDAR AUSTRALIANO 4360:2004

### OBJETIVO:

El curso 100% práctico, está dirigido a los funcionarios cuyas funciones y responsabilidades estén relacionadas a la gestión integral de riesgo. Al término de la capacitación el participante tendrá una mayor comprensión de los principales estándares internacionales para la gestión del riesgo, conocimiento que le permitirá diseñar un entorno interno apropiado, desarrollar una adecuada determinación de objetivos, implementar una oportuna identificación, evaluación, tratamiento y control de riesgos, así como elaborar los reportes pertinentes y efectuar un adecuado monitoreo de los distintos riesgos que enfrenta una institución.

### TEMARIO:

- Conceptos básicos de Gestión de Riesgo Operacional
- Requerimientos regulatorios vigentes por la Superintendencia de Banca y Seguros
- Roles y Responsabilidades en la Gestión de Riesgo Operacional
- Implementación del Modelo Standard Australiano y COSO ERM en la Gestión de Riesgo Operacional
- Autoevaluación Mapeo de procesos (Sistema Financiero) Definición de cadena de valor para la gestión de riesgo.
- Mapeo Autoevaluación de riesgo (Mapa de Riesgos y Controles)
- Implementación del Modelo de Gestión del Riesgo Legal
- Taller de autoevaluación de riesgos y controles
- Base de Datos de Pérdida e Indicadores Clave de Riesgo
- Conceptos Base de datos de perdidas
- Proceso de Recolección de base de datos
- Cuentas contables
- Indicadores Clave de Riesgo
- Sistema de Incentivos
- Reportes de Gestión
- Evaluación de Nuevos Productos o cambios significativos
- Evaluación de Riesgos de Subcontrataciones Significativas
- Cálculo del Capital



**IMF CONSULTING SAC**  
MICROFINANZAS & COOPERATIVAS

- Método estándar alternativo: Calculo requerimiento de capital
- Requerimiento de Capital Regulatorio (Implementación Basilea)
- Método básico – BIA
- Método estándar alternativo – ASA
- Modelo Avanzado: Aplicación ASA
- Auditorias y Certificaciones requeridas para la aplicación ASA
- Modelo AMA: Definiciones Básicas
- Información Base del Modelo
- Métodos Avanzados AMA
- Método de Medición Interna – IMA
- Cuadro de Mando - Scorecard
- Modelo de Distribución de Pérdidas - LDA

#### **DURACION:**