



CURSO VIRTUAL

CURSO GESTIÓN Y ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS FINANCIEROS

Objetivo:

El Curso de Gestión y Administración de Riesgos, permite que el participante identifique y profundice en la administración de los diferentes tipos de riesgos financieros y no financieros a los que están expuestas la entidad del sector financiero, bursátil, asegurador, sector real y público,

Adicionalmente, los participantes tendrán la oportunidad de aplicar los conceptos y herramientas que se desarrollan en el curso, a los activos y casos del mercado colombiano, donde se tiene en cuenta la normativa vigente de la Superintendencia financiera, así como las recomendaciones del Comité de Basilea, COSO y la norma ISO 31.000.

Certificado:

La aprobación del curso se certifica mediante Diploma expedido por Asobursatil y la Bolsa de Valores de Colombia, a quienes hayan asistido por lo menos al 80% de las horas programadas para cada una de las materias.

Duración:	30 horas
Inversión:	900.000 + IVA
Fecha de Inicio:	14 de junio 2022
Fecha de Culminación:	5 de julio de 2022
Horario:	Lunes a jueves de 6:00 a 9:00 P.M.

CONTENIDO TEMÁTICO

MODULO I: INTRODUCCIÓN Y ESTRUCTURA DEL MERCADO

1. Operaciones de Mercado Financiero y Bursátil
 - a. Operaciones Contado, simultaneas, Repos, TTVs



MODULO II: ESTADISTICA PARA ANALISIS DE RIESGOS FINANCIEROS

1. **Estadística descriptiva**
 - a. Funciones de distribución.
 - b. Media, varianza, kurtosis y apuntalamiento.

2. **La volatilidad**
 - a. Volatilidad histórica
 - b. Volatilidad implícita
 - c. Modelo EWMA de Volatilidad

MODULO III: TENDENCIAS EN LA GESTION DE RIESGOS Y EL CASO COLOMBIANO

1. **Recomendaciones del Comité de Basilea I,II y III**
2. **Introducción a los riesgos financieros y no financieros, tipos y conceptos**
3. **El caso colombiano:**
 - SARC
 - SARM
 - SARL
 - SARO
 - Seguridad de la Información
 - Plan de Continuidad de Negocio (BCP)
 - SARLAFT

MODULO IV: ESTRUCTURA DE LA GESTIÓN DE RIESGOS

1. **ISO 31000. Aspectos mínimos que se deben observar en la Gestión de Riesgos.**
 - Políticas
 - Procedimientos
 - Estructura Organizacional
 - Control

2. **Metodologías de Medición de Riesgo**

3. **Margen de Solvencia**

4. **Normatividad del Autoregulador del Mercado de Valores:**

MODULO V: MEDICIONES DE RIESGO

1. **Medición del Riesgo de Mercado**
 - **Riesgo de Tasa de Interés**
 - Identificación del Riesgo
 - Métricas :
 - VAR Regulatorio



- VAR Estándar
- VAR Interno
- Var paramétrico,
- Var Histórico,
- Var Montecarlo

- **Riesgo de Tasa de Cambio**
 - Identificación del Riesgo
 - Métricas
- **Carteras Colectivas**
 - Identificación del Riesgo
 - Métricas
- **Precio de Acciones**
 - Identificación del Riesgo
 - Métricas
- **Análisis de Stress Testing y Back Testing**
 - VAR de los Forwards

2. Medición del Riesgo de Crédito

- Método de Expertos
- Scoring de Crédito
- Modelo de Altman
- Modelo CAMEL
- Modelo de Pérdida Esperada
- Probabilidad de incumplimiento
- Probabilidad dado el incumplimiento
- Exposición al Default
- Matrices de Transición
- Cámaras de Riesgo Central de contraparte: Riesgo-Divisas

3. Medición del Riesgo de Líquidez

- Factores que generan Riesgo de Liquidez
- Cálculo IRL:
 - Activos líquidos ajustados por liquidez de Mercado y Riesgo Cambiario
 - Requerimientos de liquidez netos
 - Activos Líquidos de Alta calidad.
- Brechas de Liquidez
- Análisis de Flujos de Caja
- Indicador de Herfindal & Hirsman
- Indicadores de Riesgo de Liquidez

4. Medición del Riesgo Operativo

- Cálculo Riesgo Inherente
- Cálculo Residual
- Cómo Calcular Riesgo
- Mapas de Riesgo
- Mediciones Regulatorias Basilea para Cálculo de Capital por Riesgo Operativo

5. Riesgo de SARLAFT

- Identificación
- Segmentación

- PEP's
- ROS – ROE
- Operaciones inusuales.
- Medición del Riesgo de Lavado de Activos y Financiación del Terrorismo

Sea esta una oportunidad para poner a su disposición toda la información relativa a los programas que a la fecha tenemos y que los pueden consultar en nuestra página web www.asobursatil.org.