

# Curso de ADMINISTRACIÓN DE RIESGO OPERATIVO

## OBJETIVO:

Los participantes obtendrán elementos teóricos y prácticos que les permitan una adecuada identificación, administración y control del riesgo operativo.

Para la identificación se detallarán sus componentes que lo conforman y que permitirán una clasificación; para su administración aprenderán una metodología basada en los estándares internacionales AS/NZS 4360 y COSO así como las generalidades del acuerdo de Basilea II; con ello podrán monitorear la exposición a los riesgos operaciones, es decir, obtendrán los conocimientos que les permitan prevenir y/o controlar riesgos mediante procesos de operación diaria con el objetivo de obstaculizar la materialización del riesgo o minimizar su impacto.

## ALCANCE:

El participante aprenderá una metodología para la administración de riesgos basada en el estándar australiano AS/NZS 4360 así como en COSO.

Al final del curso, como parte didáctica del mismo se hará un ejemplo aplicando dicha metodología en un riesgo particular: identificándolo, clasificándolo administrándolo y monitoreándolo. Para agilizar esta parte del curso, se usará el software DELOS ARO, software IDEA y @risk para el cálculo del VaR.

## CONTENIDO TEMÁTICO:

- I. Introducción
  - Antecedentes
  - Importancia de la administración de riesgos
  - ¿Dónde puede aplicarse la administración de riesgos?
  - Definiciones
- II. Elementos principales para la administración de riesgos
  - 1) Comunicación y consulta dentro de la organización
    - ¿Por qué es importante?
    - ¿Cómo hacerla?
    - Proceso de comunicación y consulta
  - 2) Establecer el contexto
    - Objetivos y ambiente
    - Identificación de stakeholders
    - Criterios para evaluar riesgos
    - Criterios para evaluar consecuencias
    - Elementos para estructurar la evaluación de riesgos
    - Documentación
  - 3) Identificación de riesgos
    - Componentes de un riesgo
    - Proceso de identificación de riesgos
    - Información para la identificación de riesgos
    - Acercamientos para la identificación de riesgos

- Ejemplos de técnicas de identificación de eventos
  - Categorías de eventos
  - Documentación
- 4) Análisis de riesgos
- Bases
  - Consecuencias y probabilidades
  - Nivel de riesgo
  - La incertidumbre
  - Análisis de oportunidades
  - Métodos de análisis
  - Preguntas clave en el análisis de riesgos
  - Documentos en esta fase
- 5) Evaluación de riesgos
- Tipos de criterios de evaluación
  - Estimación de la probabilidad de ocurrencia y el impacto
  - Tolerancia al riesgo
  - Criterios de evaluación y eventos históricos
- 6) Tratamiento de riesgos
- Identificación de opciones
  - Comprensión de las causas
  - Planes de contingencia
  - Tipos de tratamiento de riesgos
  - Diseño de tratamientos de riesgos
  - Selección de opciones de tratamiento de riesgos
  - Balance entre costos y beneficios
  - Análisis de costos y beneficios
  - Preparación de planes de tratamiento
  - Riesgo residual
- 7) Monitoreo de riesgos
- Cambios en el contexto y los riesgos
  - Aseguramiento de la administración de riesgos y monitoreo
  - Monitoreo continuo
  - Auditoría externa
  - Importancia de la medición del desempeño de la administración de riesgos
  - Análisis post-eventos
- III. Actividades de control
- Integración con respuestas al riesgo
  - Tipos de actividades de control
  - Políticas y procedimientos
  - Controles sobre sistemas de información
  - Controles generales
  - Aplicación de controles
- IV. Registro del proceso de administración de riesgos
- Registro de riesgos
  - Calendario de tratamiento de riesgos y plan de acción
  - Documentos de monitoreo y auditoría
  - Base de datos de incidencias
  - Plan de administración de riesgos
- V. Administración eficaz del riesgo
- Política
  - Compromiso con la dirección
  - Responsabilidad y autoridad

- Recursos e infraestructura
- Cambio de cultura
- Monitoreo y revisión de la actividad del riesgo
- El desafío para los líderes – INTEGRACIÓN
- El desafío para los managers – LIDERAZGO
- El desafío para todos – MEJORA CONTINUA

VI. Generalidades del Acuerdo de Basilea II

- Breve introducción
- Los tres pilares
- Definición de Riesgo Operativo según Basilea II
- Mejores prácticas recomendadas en Basilea II
- Retos en la Administración de Riesgo Operativo en el contexto de Basilea II
- Diferencias entre riesgo operativo contra los riesgos de crédito y de mercado

VII. Cálculo del VAR (Valor al Riesgo)

- Elementos Teóricos de Probabilidad y Estadística
- Análisis Estadístico de Datos
- Introducción a la simulación y modelado

VIII. Ejemplo práctico de la metodología y cálculo del VAR



**Currícula de los Instructores:**

**Gustavo Adolfo Solís Montes**

*El Sr. Solís es Licenciado en Contaduría con especialidad en finanzas, egresando de la Universidad Nacional Autónoma de México. Obtuvo el grado de Maestría en Sistemas de Información del Instituto Tecnológico y de Estudios Superiores de Monterrey. Actualmente se encuentra cursando el programa de Doctorado en Administración de la Universidad Nacional Autónoma de México.*

*Cuenta con las siguientes certificaciones:*

- *CISA (Certified Information Systems Auditor) 1987.*
- *CISM (Certified Information Security Manager) 2004.*
- *ITIL (Foundation Certificate in IT Service Management) 2005.*
- *COBIT (Accredited Trainer for COBIT) 2005.*
- *CGETI (Certified in the Governance of Enterprise IT) 2009.*



*Sr. Solís laboró en la Firma de Ernst & Young, de 1980 a 1996, tanto en la Ciudad de México como en la oficina de Nueva York, llegando a la Sociedad de dicha Firma en el año de 1992. En agosto de 1997 El Sr. Solís fundó Grupo Cynthus.*

*El Sr. Solís fue miembro titular del Comité de Auditoría de BANSEFI.*

*Actualmente es el Presidente del Capítulo de la Ciudad de México de la ISACA, cargo que ocupará en el período 2010-2011. En cuanto a su participación en la ISACA internacional, ésta ha incluido los siguientes puestos, entre otros:*

- *Vicepresidente Internacional de ISACA*
- *Vicepresidente Regional para Latino América*
- *Miembro del IT Governance Committee.*
- *Miembro del IT Assurance Strategy Committee.*

*Es autor del libro “Reingeniería de la Auditoría Informática” de Editorial Trillas y Coautor del libro “Seguridad de las Tecnologías de la Información” publicado por AENOR, España.*

### **Leonora Eliana Mulia Alvarez**

*Licenciada en Sistemas de Computación Administrativa, egresada del Instituto Tecnológico de Estudios Superiores de Monterrey. Obtuvo la certificación en Administración de Riesgos **CRM** en 2009.*

*Su experiencia profesional se ha orientado a la incorporación de Tecnologías de Información a los Procesos de Negocio y en los últimos años a la Administración de Riesgos.*

*Inició su carrera como desarrollador de sistemas de información en la empresa de consultoría Servicios y Proyectos en Sistemas, durante su colaboración desarrolló proyectos para clientes como Posadas de México, Factoraje Bancomer, Reinmex, entre otros. Como resultado de su desempeño, participó como gerente de proyectos, implementando metodologías de desarrollo de software y administración de proyectos.*

*Posteriormente, colaboró como responsable de la implementación del software colaborativo Lotus Notes en proyectos con empresas de diferentes sectores.*

*Se incorporó a la firma de consultoría Grupo Cynthus donde ha colaborado en proyectos de consultoría relacionados con la definición y mejora de procesos, así como la alineación de los procesos a la estrategia de la empresa.*

*En lo que se refiere a Administración de Riesgos ha participado en proyectos de implementación de la función de administración de riesgo operativo el cual incluye el riesgo tecnológico.*

*Asimismo, en Grupo Cynthus la Lic. Mulia es responsable del producto de software Delos ARO y es instructora del curso de Administración de Riesgos.*

### **René Rensoli Castañeda**

*Actuario egresado de la Universidad Nacional Autónoma de México, con la tesis Probabilidades, Anualidades y Seguro de personas en 1984, con experiencia de más de 25 años en planeación, análisis y reingeniería de procesos, así como en análisis de riesgos.*

*El Sr. Rensoli ha ocupado distintos cargos en la administración pública, privada y paraestatal siempre relacionado con esos temas. Entre los que destaca Gerente de Sistemas en el Aeropuerto Internacional de la Ciudad de México y responsable del área de Riesgos Crediticios en el extinto Banco Nacional de Comercio Interior.*

*Adicionalmente se ha desempeñado por más de 15 años como profesor de Reaseguro y Cálculo Actuarial en la carrera de actuaría, en Facultad de Ciencias de la UNAM, así como en docencia en materia de sistemas, procesos y computación.*

*Actualmente el Sr. Rensoli es consultor del Grupo Cynthus en el análisis cuantitativo de Riesgo Operativo y en temas asociados con el cálculo de probabilidades y el software @risk.*

**Material:** Se entregará el material del curso a cada participante.

**Duración:** 24 horas, distribuido en 3 sesiones de 8 horas diariamente

**Inversión:** Los planes de capacitación se ofrecen en dos modalidades,

- Cursos compañía: Ofrecidos para empresas que requieren capacitar por lo menos a 6 personas y un máximo de 12; el costo es de **\$ 6,000.00 USD más IVA** por curso. Se lleva a cabo en las instalaciones de la empresa y la fecha es propuesta por ustedes.
- Curso abierto: Se programan de manera periódica, asisten participantes de manera individual o cuyas empresas requieren capacitación de una a cinco personas. El costo del curso es de **\$ 950.00 USD más IVA** por persona. Se lleva a cabo en nuestras instalaciones y en nuestras fechas programadas.

#### **Lugar y Fecha:**

Para curso compañía, la capacitación se llevará a cabo en sus instalaciones en las fechas propuestas por ustedes.

Los cursos abiertos programados para 2011 se llevarán a cabo:

- Del 16 al 18 de Febrero
- Del 6 al 8 de Abril
- Del 21 al 23 de Septiembre

y se impartirán en:

WTC, Montecito 38, piso 29 oficinas 25 y 26  
Col. Nápoles, 03810, México, D.F.

#### **Forma de Pago:**

El pago de la inversión deberá hacerse a más tardar tres días anteriores del día de inicio aunque podemos adaptarnos a las políticas de pago de su empresa. Deberá ser al tipo de cambio del día de pago en cualquiera de las siguientes formas:

##### **Depósito bancario.-**

- Si el depósito es en moneda nacional, favor de hacerlo a nombre de Grupo Cynthus, S.A. de C.V., Banco BANORTE Número de Cta. 0680 009 333 Suc. 1322 CLABE 07218000680009333-4.
- Si el depósito es en dólares, favor de hacerlo a nombre de Grupo Cynthus, S.A. de C.V., Banco BANCOMER Número de Cta. 013 239 58 43 Suc. 3646 CLABE 01218000132395843-2

En ambos casos favor de enviar ficha de la transferencia o depósito.

**Cheque.-** A nombre de Grupo Cynthus, S.A. de C.V., entregado en nuestra oficina.

**Tarjeta Bancaria.-** excepto American Express, en nuestras instalaciones.

Nota: Para los cursos abiertos, nos reservamos el derecho de cancelación en caso de no contar mínimo con 6 participantes.

Para mayor información, favor de contactar al teléfono 90 00 52 22 a Laura Ruelas ext 105 [lruelas@cynthus.com.mx](mailto:lruelas@cynthus.com.mx) o a María Eugenia Montes ext. 109 [memontes@cynthus.com.mx](mailto:memontes@cynthus.com.mx)