

<b>CARGA HORARIA:</b>	16 horas
<b>FECHAS:</b>	Miércoles 23 y Jueves 24 de Febrero, 2005
<b>ORADOR:</b>	Prof. César A. Duque Arbelaez (Colombia)

## **OBJETIVO:**

Esté Módulo tiene como propósito proporcionar a los participantes una visión integral para el manejo costo-eficiente de los riesgos propios de la industria bancaria, así como una metodología para identificar y valorar los riesgos, determinar el impacto posible de los mismos en el negocio, como base para adoptar estrategias y programas para su control. El Módulo 1 se completa con un Taller destinado a desarrollar un Método probado de Identificación y Evaluación de Riesgos.

## **TEMARIO:**

### **METODOLOGIA PARA LA IDENTIFICACION DE RIESGOS, AMENAZAS Y VULNERABILIDADES**

#### **GESTION DE RIESGOS**

- Teoría General del Riesgo Aplicada al Sector Bancario
- Impacto de los Riesgos sobre el Negocio
- Alcances, Metas y Estructura de un programa de la Gestión del Riesgo
- Etapas del Proceso
- La Seguridad en el Marco de la Gestión de Calidad

#### **FUENTES DE AMENAZA EN EL NEGOCIO BANCARIO**

- Identificación y Análisis de los Factores de Riesgo de Origen
  - Intencional (Dolosos)
  - Intencional (No Dolosos)
  - Tecnológico
  - Natural

### **EVALUACION DE RIESGOS**

#### **METODOS Y CRITERIOS DE EVALUACION**

- Proceso de Evaluación de Riesgos
- Métodos Cualitativos y Cuantitativos
- Ingeniería de Riesgos
- Método GIRO

#### **METODOLOGIA**

- Identificación de Escenarios
- Escalas de Valoración y Criterios de Aceptabilidad
- Cálculo de los Niveles de Riesgo e Impacto
- Uso de Estadísticas de Siniestralidad
- Construcción de los Perfiles de Riesgo
- Definición de Prioridades

#### **INTERPRETACION DE RESULTADOS**

#### **BENCHMARKING DEL AREA DE SEGURIDAD**

- Indices e Indicadores de Riesgo y Vulnerabilidad
- Valoración del “Clima” de Riesgo Social

### **TALLER:**

#### **ESTUDIO DE CASO PRACTICO**

- Desarrollo de Caso de Identificación y Evaluación de Riesgos con aplicación de la Metodología GIRO
- Análisis de Riesgos y Vulnerabilidad
- Determinación de estrategias y evaluación de alternativas de intervención
- Análisis de Costo Beneficio de las medidas
- Planteamiento y Panel de Respuestas