



DIPLOMADO “GESTIÓN DE RIESGOS SARLAFT, SARO, SARC, SARL Y SARM”

**100 Horas
PRESENCIAL**

“La mente que se abre a una nueva idea jamás volverá a su tamaño original”. Albert Einstein

CONTENIDO DEL PROGRAMA



Objetivo

- Proporcionar los conceptos, criterios, metodologías y herramientas necesarias que les permita a los participantes desarrollar competencias específicas (habilidades y conocimientos) para el ejercicio de una adecuada gestión del riesgo.
- Capacitar a los participantes en una visión completa de su cargo y en la solución de problemas relacionados con la Administración del Riesgo y en la gestión de situaciones relacionadas con LAFT.



Contenido

MÓDULO 1: INTRODUCCIÓN A GESTIÓN DEL RIESGO – 10 Horas

1. Concepto general y definición de riesgo.
2. El sistema de gestión de riesgos y el control interno
3. Principios de la gestión del riesgo
4. Gestión integral de riesgos – Marco de Referencia COSO e ISO 31000
5. Implementación del marco de referencia
6. Definición de riesgos inherentes y riesgos residuales
7. Definición de apetito de riesgo y niveles de tolerancia
8. Metodología para identificación de riesgos, causas y consecuencias
9. Metodología para la parametrización de la probabilidad e impacto
10. Metodología para evaluar el diseño y eficacia de los controles
11. Elaboración de mapas de riesgos inherentes y residuales
12. Matrices de eventos de riesgo

MÓDULO 2: SISTEMA DE ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO DE LAVADO DE ACTIVOS Y DE LA FINANCIACIÓN DEL TERRORISMO (SARLAFT) – 30 Horas

Marco Legal:

1. Definición lavado de activos y financiación del terrorismo implicaciones (Ley 1121/2016 1762/2015).
2. Código Penal (régimen sanciones pecuniarias, civiles, administrativas).
3. Responsabilidades, deberes y obligaciones del oficial/empleado de cumplimiento /sector real y financiero.
4. Normativa Internacional.
5. Grupo Egmont, GAFI, GAFILAT, UIAF.
6. Talleres prácticos sobre todos los temas abordados.

Marco Teórico

7. Etapas y Elementos
8. Metodología de identificación y Medición
9. Controles preventivos versus Controles Correctivos
10. Eventos de Lavado versus Eventos de Financiación
11. Mecanismos e Instrumentos

12. Conocimiento del Cliente como columna vertebral del SARLAFT
13. Órganos de Control responsabilidades y funciones
14. Talleres prácticos sobre todos los temas abordados

Casos Prácticos

15. Programas de Cumplimiento - Identificación de vulnerabilidades en la organización
16. Operaciones Normales versus Operaciones Inusuales
17. Diferencia entre señales de alerta y operaciones inusuales
18. Metodología para detección de operaciones sospechosas
19. Casos reales de lavado de activos, detección y reporte
20. Mapa de Riesgo enfocado a SARLAFT
21. Evaluación de los controles SARLAFT (Monitoreo)
22. Factores de Riesgo (Análisis)
23. Tipologías para el Lavado de Activos

MÓDULO 3: RIESGO OPERATIVO. (SARO) 10 HORAS

1. Fuentes del riesgo operativo
2. Técnicas para la medición y cuantificación del riesgo operativo
3. Etapas de la administración del riesgo operativo
 - a. Identificación
 - b. Medición
 - c. Control
 - d. Monitoreo
4. Elementos del Sistema de Administración de Riesgo Operativo - SARO
5. Marco Legal aplicable a sector solidario
6. Talleres y Casos prácticos.

MÓDULO 4: BASES ESTADÍSTICAS PARA EL ANÁLISIS CUANTITATIVO DE RIESGOS ENFOCADO AL SARLAFT – 10 Horas

1. Introducción y definición de análisis cuantitativo en riesgos.
2. Identificación de segmentos de riesgo con algoritmos de clustering e inteligencia artificial.
3. Reportar adecuada y anticipadamente transacciones sospechosas, según los modelos.
4. Identificar y caracterizar transacciones y eventos inusuales y/o sospechosos de fraude.
5. Encontrar variables sensitivas en riesgo operativo para proyección de pérdidas.
6. Talleres y casos prácticos enfocados en el SARLAFT.

MÓDULO 5: RIESGO DE CRÉDITO – 10 Horas

1. Conceptos y generalidades del SARC
2. Evaluación del Riesgo de Crédito
3. Gestión del Riesgo de Crédito: Ciclo integral de Riesgo de Crédito
4. Indicadores del Riesgo de Crédito (Scoring, variables macroeconómicas y el ciclo de tesorería)
5. Diferencias entre riesgo de crédito de personas y empresas

- 6. Seguimiento y mantenimiento
- 7. Recuperación de ventas de cartera
- 8. Medición del riesgo de crédito, su impacto económico.
- 9. Metodología para cuantificar el impacto del ciclo (Monitoreo, Control y Mitigación)
- 10. Talleres y casos prácticos sobre todos los temas abordados.

MÓDULO 6: RIESGO DE LIQUIDEZ. (SARL) 10 HORAS

- 1. Marco Legal. (Supersolidaria).
- 2. Introducción
- 3. Riesgo de Liquidez
- 4. Generalidades
- 5. Concepto
- 6. Riesgo de liquidez de mercado
- 7. Liquidez asociada a fondos (incluye fondos de empleados)
- 8. Liquidez asociada a riesgo de crédito
- 9. Relación entre riesgo de liquidez, crédito y mercado
- 10. Gestión del Riesgo liquidez.
- 11. Identificación
- 12. Medición del Riesgo de liquidez
- 13. Brechas de liquidez (GAPs)
- 14. IRL
- 15. ALM (Assets and liabilities management)
- 16. LaR (Liquidity at risk)
- 17. Monitoreo y control
- 18. Plan de contingencia de liquidez
- 19. Stress test de liquidez
- 20. Mitigación
- 21. Talleres prácticos sobre todos los temas abordados.

MÓDULO 7: RIESGO DE MERCADO – 10 Horas

- 1. Introducción y definición de riesgo de mercado.
- 2. Etapas de la administración de riesgos.
- 3. Elementos del riesgo de mercado.
- 4. Riesgo de tasa de interés
- 5. Riesgo de tipo de cambio
- 6. Gestión del riesgo de mercado
- 7. Clasificación de inversiones
- 8. Medición del Riesgo de Mercado
- 9. VaR (Value at Risk)
 - Definición
 - Conceptos fundamentales
 - Repaso de herramientas estadísticas
 - Tendencia central
 - Cálculo de volatilidades
 - Correlaciones.

MÓDULO 8: DISEÑO DE PLANES DE EMERGENCIA Y CONTINGENCIA – 10 Horas

- 1. Definición y concepto de la administración de la continuidad del negocio.
- 2. Procedimientos y metodologías.
- 3. Prevención y atención de emergencias.
- 4. Administración de crisis.

5. Planes de contingencia y continuidad
6. Capacitación y divulgación de información
7. Talleres prácticos sobre todos los temas abordados.



INTENSIDAD:

100 horas
(viernes y sábado)



HORARIO:

Viernes: 5:00 pm-9:30pm
sábado: 7:00. am.-12:30m



INICIO:

A partir del 27 de
septiembre de 2019 hasta el
30 de noviembre



LUGAR:

Colegio San
Ignacio Calle 48 N° 68-98
Medellín

CERTIFICACIÓN

La Universidad Javeriana otorgará el certificado de participación a quienes hayan cumplido los siguientes requisitos:

- Participación satisfactoria en el desarrollo de todos y cada uno de los módulos, en las discusiones e intercambio de experiencias.
- Asistencia y puntualidad por lo menos al 80% de las horas programadas.



INCLUYE:

- Materiales
- Refrigerios
- Certificado de asistencia

INVERSIÓN:



Entidad asociada: 2.200.000+IVA
Entidad no asociada: 2.450.000+IVA

INFORMES E INSCRIPCIONES



MARIANA TRUJILLO

Teléfono: 3176683428
Email: analfemed@analfe.org.co
www.analfe.org.co