



INESEM

BUSINESS SCHOOL

***Especialista en Riesgo Operacional. Metodología
para su medición y control***

+ Información Gratis

titulación de formación continua bonificada expedida por el instituto europeo de estudios empresariales

Especialista en Riesgo Operacional. Metodología para su medición y control

duración total: 200 horas

horas teleformación: 100 horas

precio: 0 € *

modalidad: Online

* hasta 100 % bonificable para trabajadores.

descripción

Este curso en Riesgo Operacional. Metodología para su medición y control le ofrece una formación especializada en la materia. El Riesgo operacional es aquel que puede provocar pérdidas debido a errores humanos, procesos internos inadecuados o defectuosos, fallos en los sistemas y como consecuencia de acontecimientos externos. Con el presente curso de Riesgo Operacional se pretende aportar los conocimientos necesarios para gestionar, medir y controlar el riesgo operacional debido a la importancia que tiene sobre el valor de las organizaciones.



+ Información Gratis

a quién va dirigido

Todos aquellos trabajadores y profesionales en activo que deseen adquirir o perfeccionar sus conocimientos técnicos en este área.

objetivos

- Conocer las funciones del Comité de Basilea.
- Identificar el riesgo operacional y cuantificar la pérdida operacional.
- Aprender las prácticas y las herramientas correctas para gestionar el riesgo operacional.
- Llevar a cabo la medición del riesgo operacional.
- Aprender el capital regulatorio por riesgo operacional.

para qué te prepara

Este curso de Riesgo Operacional. Metodología para su medición y control te prepara para que el alumno sea capaz de gestionar y medir el riesgo operacional y analizar los principales rasgos tanto de las herramientas cualitativas de control como de las metodologías de medición.

salidas laborales

Experto en Riesgo Operacional, Dirección de Empresas, Auditoría.

titulación

Una vez finalizado el curso, el alumno recibirá por parte de INESEM vía correo postal, la Titulación Oficial que acredita el haber superado con éxito todas las pruebas de conocimientos propuestas en el mismo.

Esta titulación incluirá el nombre del curso/máster, la duración del mismo, el nombre y DNI del alumno, el nivel de aprovechamiento que acredita que el alumno superó las pruebas propuestas, las firmas del profesor y Director del centro, y los sellos de la instituciones que avalan la formación recibida (Instituto Europeo de Estudios Empresariales).



INSTITUTO EUROPEO DE ESTUDIOS EMPRESARIALES

como centro de Formación acreditado para la impartición a nivel nacional de formación
EXPIDE LA SIGUIENTE TITULACIÓN

NOMBRE DEL ALUMNO/A

con D.N.I. XXXXXXXX ha superado los estudios correspondientes de

Nombre de la Acción Formativa

de XXX horas, perteneciente al Plan de Formación INESEM en la convocatoria de XXXX
Y para que surta los efectos pertinentes queda registrado con número de expediente XXXX- XXXX-XXXX-XXXXXX

Con una calificación de SOBRESALIENTE

Y para que conste expido la presente TITULACIÓN en
Granada, a (día) de (mes) de (año)

La dirección General

MARIA MORENO HIDALGO

Firma del alumno/a

Sello



NOMBRE DEL ALUMNO/A

forma de bonificación

- Mediante descuento directo en el TC1, a cargo de los seguros sociales que la empresa paga cada mes a la Seguridad Social.

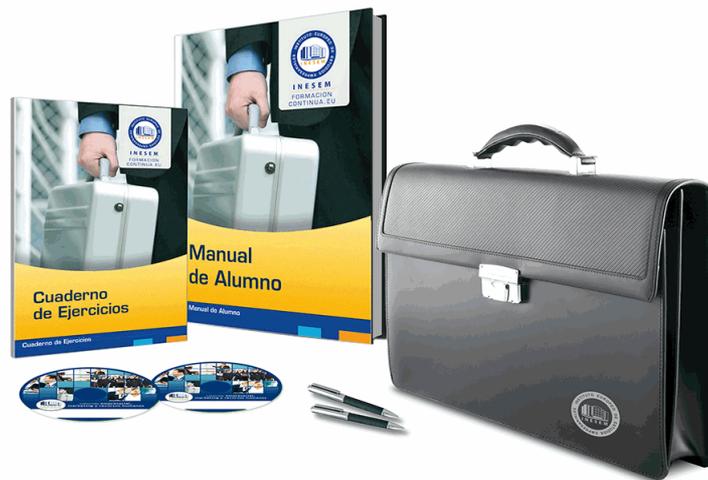
metodología

El alumno comienza su andadura en INESEM a través del Campus Virtual. Con nuestra metodología de aprendizaje online, el alumno debe avanzar a lo largo de las unidades didácticas del itinerario formativo, así como realizar las actividades y autoevaluaciones correspondientes. Al final del itinerario, el alumno se encontrará con el examen final, debiendo contestar correctamente un mínimo del 75% de las cuestiones planteadas para poder obtener el título.

Nuestro equipo docente y un tutor especializado harán un seguimiento exhaustivo, evaluando todos los progresos del alumno así como estableciendo una línea abierta para la resolución de consultas.

El alumno dispone de un espacio donde gestionar todos sus trámites administrativos, la Secretaría Virtual, y de un lugar de encuentro, Comunidad INESEM, donde fomentar su proceso de aprendizaje que enriquecerá su desarrollo profesional.

materiales didácticos



+ Información Gratis

profesorado y servicio de tutorías

Nuestro equipo docente estará a su disposición para resolver cualquier consulta o ampliación de contenido que pueda necesitar relacionado con el curso. Podrá ponerse en contacto con nosotros a través de la propia plataforma o Chat, Email o Teléfono, en el horario que aparece en un documento denominado “Guía del Alumno” entregado junto al resto de materiales de estudio.

Contamos con una extensa plantilla de profesores especializados en las distintas áreas formativas, con una amplia experiencia en el ámbito docente.

El alumno podrá contactar con los profesores y formular todo tipo de dudas y consultas, así como solicitar información complementaria, fuentes bibliográficas y asesoramiento profesional.

Podrá hacerlo de las siguientes formas:

- **Por e-mail:** El alumno podrá enviar sus dudas y consultas a cualquier hora y obtendrá respuesta en un plazo máximo de 48 horas.

- **Por teléfono:** Existe un horario para las tutorías telefónicas, dentro del cual el alumno podrá hablar directamente con su tutor.

- **A través del Campus Virtual:** El alumno/a puede contactar y enviar sus consultas a través del mismo, pudiendo tener acceso a Secretaría, agilizando cualquier proceso administrativo así como



plazo de finalización

El alumno cuenta con un período máximo de tiempo para la finalización del curso, que dependerá de la misma duración del curso. Existe por tanto un calendario formativo con una fecha de inicio y una fecha de fin.

campus virtual online

especialmente dirigido a los alumnos matriculados en cursos de modalidad online, el campus virtual de inesem ofrece contenidos multimedia de alta calidad y ejercicios interactivos.

comunidad

servicio gratuito que permitirá al alumno formar parte de una extensa comunidad virtual que ya disfruta de múltiples ventajas: becas, descuentos y promociones en formación, viajes al extranjero para aprender idiomas...

revista digital

el alumno podrá descargar artículos sobre e-learning, publicaciones sobre formación a distancia, artículos de opinión, noticias sobre convocatorias de oposiciones, concursos públicos de la administración, ferias sobre formación, etc.

secretaría

Este sistema comunica al alumno directamente con nuestros asistentes, agilizando todo el proceso de matriculación, envío de documentación y solución de cualquier incidencia.

Además, a través de nuestro gestor documental, el alumno puede disponer de todos sus documentos, controlar las fechas de envío, finalización de sus acciones formativas y todo lo relacionado con la parte administrativa de sus cursos, teniendo la posibilidad de realizar un seguimiento personal de todos sus trámites con INESEM

programa formativo

UNIDAD DIDÁCTICA 1. EL COMITÉ DE BASILEA Y LOS ACUERDOS DE CAPITAL

- 1.Introducción
- 2.El Comité de Supervisión Bancaria de Basilea
 - 1.- Funciones del Comité de Basilea
 - 2.- Naturaleza y estructura del Comité de Basilea
 - 3.- Trabajos y publicaciones del Comité de Basilea
- 3.El Acuerdo de Basilea I
 - 1.- El coeficiente de solvencia y los recursos propios
 - 2.- Debilidades del Acuerdo de Basilea I
- 4.El Acuerdo de Basilea II
 - 1.- Estructura del Acuerdo de Basilea II
 - 2.- El ámbito de aplicación
 - 3.- Los tres pilares
- 5.Pilar I: Requerimientos de capital
 - 1.- Riesgo de crédito
 - 2.- Riesgo de mercado
 - 3.- Riesgo operacional
 - 4.- Los recursos propios computables
- 6.Pilar II: Revisión supervisora
- 7.Pilar III: Disciplina de mercado
- 8.La implementación del Acuerdo de Basilea II
 - 1.- Basilea II y los retos para el supervisor
 - 2.- El grupo de Implementación del Acuerdo (AIG)
 - 3.- La implementación en la Unión Europea
- 9.Basilea III: El nuevo reto del sistema financiero

UNIDAD DIDÁCTICA 2. LA IDENTIFICACIÓN E IMPORTANCIA DEL RIESGO OPERACIONAL

- 1.Introducción
- 2.La importancia del riesgo operacional en la industria financiera
 - 1.- Las irregularidades bancarias
 - 2.- El fraude corporativo y la Banca
 - 3.- La Sarbanes-Oxley y el riesgo operacional
 - 4.- Operaciones bursátiles no autorizadas
 - 5.- El error humano y el riesgo operacional
 - 6.- El fraude bancario a través de Internet
- 3.Los riesgos bancarios
 - 1.- Riesgo y volatilidad
 - 2.- El capital económico y el RAROC
 - 3.- Tipología de riesgos bancarios
- 4.Definición de riesgo operacional
 - 1.- Del riesgo operativo al operacional
 - 2.- Factores de riesgo operacional
 - 3.- La definición del Comité de Basilea
- 5.La tipología de riesgos operacionales
- 6.La pérdida operacional
 - 1.- Pérdidas esperadas y no esperadas
 - 2.- Severidad y frecuencia
 - 3.- Necesidad de datos externos

- 4.- Los datos internos de pérdidas
- 5.- La identificación y clasificación de la pérdida
- 6.- Clasificación por líneas de negocio
- 7.- La cuantificación de las pérdidas operacionales
- 8.- Ejercicio de recopilación de pérdidas operacionales

UNIDAD DIDÁCTICA 3. LA GESTIÓN Y CONTROL DEL RIESGO OPERACIONAL

- 1.Introducción
- 2.Prácticas correctas para la gestión del riesgo
 - 1.- Reglas de oro para la Gestión efectiva del riesgo operacional
 - 2.- Elementos Claves
 - 3.- Estructura organizativa
 - 4.- El proceso lógico de gestión
- 3.Las herramientas de gestión
 - 1.- Enfoque cualitativo
 - 2.- Enfoque cuantitativo
 - 3.- Enfoque mixtos
 - 4.- Un modelo de sinergias
- 4.El flujograma de procesos
- 5.El mapa de riesgo operacional
 - 1.- Evaluación de los riesgos
 - 2.- El riesgo inherente y el riesgo residual
 - 3.- La matriz de riesgos operacionales
 - 4.- Elaboración del mapa de riesgo operacional
 - 5.- Los planes de acción.
- 6.Auto-evaluaciones
 - 1.- Tipos de auto-evaluaciones
 - 2.- El proceso de evaluación de los puntos de control
- 7.Los indicadores de riesgo
 - 1.- Definición y propiedades de los indicadores de riesgo
 - 2.- Tipos de indicadores
 - 3.- El cuadro de mando
- 8.El modelo integral de gestión del riesgo operacional

UNIDAD DIDÁCTICA 4. LAS METODOLOGÍAS DE MEDICIÓN DEL RIESGO OPERACIONAL

- 1.Introducción
- 2.El enfoque top-down versus bottom-up. .
- 3.El método del indicador básico (bia)
 - 1.- El Coeficiente Alfa
 - 2.- El indicador de exposición
- 4.El Método Estándar (sa)
 - 1.- Los coeficientes Beta
 - 2.- El indicador de exposición
 - 3.- El Método Estándar Alternativo (ASA)
 - 4.- Requisitos para la aplicación del Método Estándar
- 5.Las metodologías avanzadas (ama)
 - 1.- Los criterios de admisión para las metodologías ama
- 6.El Modelo de Medición Interna (IMA)
 - 1.- El Índice del Perfil de Riesgo (RPI)
 - 2.- Aplicación del Enfoque IMA con un Modelo Binomial
- 7.El Modelo de Distribución de Pérdidas (LDA)
 - 1.- El concepto de Valor en Riesgo Operacional: el OpVaR.

- 2.- El proceso metodológico del LDA
- 3.- El efecto de la diversificación en el OpVaR
- 4.- La Teoría de Valores Extremos (EVT)
- 8.Los cuadros de mando (scorecards)
- 9.Análisis complementarios
 - 1.- Ejercicio de Verificación (Back-Testing)
 - 2.- Análisis de escenarios
 - 3.- Contraste de Tensión (Stress-Testing)

UNIDAD DIDÁCTICA 5. ANÁLISIS EXPLORATORIO DE LOS DATOS DE PÉRDIDAS OPERACIONALES

- 1.Introducción
- 2.El perfil de la entidad de crédito
- 3.La base de datos de pérdidas operacionales
- 4.Análisis Exploratorio de los Datos (EDA)
 - 1.- Adecuación de los datos de pérdidas operacionales
 - 2.- Distribución de las pérdidas por tipo de riesgo
 - 3.- Estadísticos descriptivos
 - 4.- Contraste de la hipótesis de normalidad
 - 5.- El tratamiento de los valores atípicos (Outliers)

UNIDAD DIDÁCTICA 6. LA MODELIZACIÓN DE LA PÉRDIDA OPERACIONAL

- 1.Introducción
- 2.La distribución de frecuencia
 - 1.- La distribución de Poisson frente a la Binomial Negativa
 - 2.- El ajuste de la frecuencia en la práctica
- 3.La distribución de severidad
 - 1.- El Modelo LDA estándar
 - 2.- La elección de la distribución de severidad
 - 3.- El impacto del umbral en la modelización de la pérdida
- 4.La Teoría de Valores Extremos

UNIDAD DIDÁCTICA 7. EL CAPITAL REGULATORIO POR RIESGO OPERACIONAL

- 1.Introducción
- 2.El capital por riesgo operacional.
 - 1.- El CaR: Modelo LDA Estándar
 - 2.- El efecto de la sobredispersión de la frecuencia en el CaR
 - 3.- El impacto de la distribución de severidad
 - 4.- Un análisis de escenarios para el riesgo del fraude interno
- 3.El impacto del umbral en el CaR
 - 1.- La distribución de Severidad
 - 2.- La distribución de Frecuencia
 - 3.- Resultados alcanzados para el conjunto riesgo operacional
 - 4.- Resultados alcanzados por tipo de riesgo
 - 5.- Cómputo a nivel de entidad
- 4.Metodologías no avanzadas de medición
 - 1.- El indicador de exposición y el multiplicador
 - 2.- Resultados alcanzados
- 5.Contraste de los capitales regulatorios
- 6.Rentabilidad ajustada al riesgo operacional
- 7.Consideraciones finales

EDITORIAL ACADÉMICA Y TÉCNICA: Índice de libro El riesgo operacional. Metodología para su medición y control. Autores: Enrique Jimenez. Publicado por Delta Publicaciones.

