



**SISTEMA INTEGRADO DE ADMINISTRACIÓN DE  
RIESGOS – SIAR PARA ENTIDADES SOLIDARIAS**

**ENFOQUE TÉCNICO Y METODOLÓGICO**

**Diplomado Práctico y Aplicado**

**BOGOTÁ OCTUBRE Y NOVIEMBRE 2021**



## I. JUSTIFICACIÓN

Con el objetivo de promover la educación en riesgos, actualizar a nuestros estudiantes a los recientes cambios normativos, los acontecimientos mundiales de pandemia y sus consecuencias al interior de las economías, hemos detectado que estos sucesos han obligado a las organizaciones a redireccionar sus estrategias, maneras de operar y han puesto a prueba sus sistemas de administración de riesgos para asegurar la continuidad de sus negocios en un escenario totalmente diferente. En este contexto las organizaciones solidarias en Colombia se vienen enfrentando principalmente a materializaciones de riesgo de crédito, liquidez, riesgos operativos y de continuidad de negocio, adicionalmente las nuevas formas de funcionamiento han incrementado las posibilidades de materialización de riesgos de LA/FT y para el caso de entidades con importantes portafolios de inversión, se ha incrementado la exposición al riesgo de mercado.

La administración de riesgos se convierte en una herramienta fundamental en estos momentos de coyuntura donde las organizaciones solidarias se están enfrentando a afectaciones de su flujo de caja, bajas opciones de financiación por parte del estado y la banca privada, la materialización del riesgo de crédito, incremento del crimen cibernético, fallas operativas en la activación de los planes de contingencia e incertidumbre del mercado respecto de decisiones del Gobierno o del comportamiento del sector económico donde se encuentra su mercado objetivo.

Frente a estas nuevas condiciones, la adecuada administración de riesgos favorece el direccionamiento y la toma de decisiones oportunas sobre las principales variables que se deben gestionar en la cartera de créditos, administración del flujo de caja, actividades operacionales, portafolios de inversión, entre otros.

En suma, a lo anterior, la supervisión basada en riesgos que viene adelantando la Superintendencia de la Economía Solidaria, y los recientes cambios normativos, presuponen para las organizaciones solidarias la necesidad de alinearse a buenas prácticas de administración de riesgos, así como a incrementar sus conocimientos y capacidad para el cumplimiento de estas normas. Esto se traduce en una necesidad de mayor inversión tanto en recursos humanos con conocimientos técnicos, como en recursos tecnológicos.

## **II. A QUIÉN ESTÁ DIRIGIDO:**

Colaboradores nacionales e internacionales que se ubiquen en el mercado financiero, estudiantes en carreras administrativas y financieras, miembros de Consejo de Administración, Juntas Directivas, Juntas de Vigilancia, Directivos y Profesionales de áreas de riesgo, auditoría, administración de crédito y cartera, tesorería y áreas de planeación financiera, así como interesadas en el control, medición, administración, y auditoría de riesgos, que deseen profundizar y ampliar sus conocimientos respecto de los diferentes riesgos del negocio y las interrelaciones naturales que se presentan entre ellos, basado en metodologías de reconocido valor técnico y ajustadas a los estándares internacionales.

## **III. VALOR AGREGADO DEL PROGRAMA**

1. Docentes con amplia trayectoria y experiencia en la administración de los diferentes sistemas de administración de riesgos y en la aplicación de métodos cuantitativos para su medición.
2. Programa 80% enfoque aplicado y 20% enfoque teórico
3. El estudiante desarrolla la habilidad de construir las metodologías e interpretar los resultados para realizar diagnósticos y para la toma de decisiones.
4. Talleres aplicados con casos reales que permiten la aplicación de las metodologías bajo la metodología aprender haciendo
5. Fortalecimiento del equipo humano de las organizaciones, desarrollando las competencias necesarias para la implementación y mantenimiento de los diferentes sistemas de gestión de riesgos y su cumplimiento regulatorio
6. Mejora las competencias profesionales en un mercado que cada vez está demandando más profesionales conocedores y especialistas en la gestión de los diferentes riesgos a los que se expone la organización solidaria
7. Como soporte de la realización el programa se emite certificado físico por parte de UdeRiesgos, entidad reconocida nacional e internacionalmente por su calidad en la estructuración y desarrollo de programas de capacitación enfocados a la gestión de riesgos financieros y no financieros

#### **IV. OBJETIVOS:**

Adquirir los conceptos claves y el conocimiento de la lectura, interpretación y competencia para la toma de decisiones, con fundamento en los resultados de las herramientas aplicadas, que permitan evaluar la adecuada identificación, medición, control y auditoría la gestión de riesgos.

Desarrollar la habilidad para reconocer el sistema integrado de gestión de riesgos como un engranaje necesario para el cumplimiento de los objetivos estratégicos y un soporte indispensable en la toma de decisiones de una forma responsable y sustentada.

Analizar los vínculos existentes entre los diferentes sistemas de riesgo y sus implicaciones. De la misma forma, se busca dar a conocer de manera general las metodologías aplicadas en la gestión de dichos riesgos y la interpretación de resultados, para soportar una adecuada y consciente forma de solucionar problemas con una base objetiva para encontrar y proponer una oportunidad de mejora en la organización o empresa, fundamentada en información pertinente, actualizada y analizada.

#### **V. ESTRUCTURA DEL DIPLOMADO**

UdeRiesgos emitirá certificado por un total de 85 horas, de las cuales son 45 horas virtuales en tiempo real, con interacción directa en aula virtual con el docente y demás participantes y 40 horas de trabajo autónomo, entre las cuales se cuentan 12 horas de participación voluntaria por el estudiante, para direccionar y supervisar el trabajo autónomo a través de tutorías, las cuales se realizarán en aula virtual en vivo.

Las sesiones de las clases (45 horas) y tutorías (12 horas) serán grabadas y estarán disponibles para los estudiantes por un tiempo de hasta dos semanas después de impartida cada sesión.

Para obtener la certificación se requiere:

1. Cumplir al menos con el 80% de asistencia a las sesiones virtuales en vivo.
2. Cumplir con al menos el 50% de las actividades de trabajo autónomo

**VI. CONTENIDO TEMÁTICO:**

**I. SISTEMA INTEGRADO DE GESTIÓN DE RIESGOS SIAR  
(3 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. FUENTES DE VALOR**
- 2. CONTEXTO**
- 3. RESPONSABILIDADES**
- 4. NORMATIVIDAD GENERAL SIAR SECTOR SOLIDARIO, CE 022 DEL 8 DE DIC DE 2020**
- 5. TIPIFICACIÓN DE LOS SISTEMAS DE GESTIÓN DE RIESGOS, TALLER APLICADO**
  - 5.1. Riesgo de crédito
  - 5.2. Riesgo Operativo
  - 5.3. Riesgo Legal
  - 5.4. Riesgo Reputacional
  - 5.5. Riesgo de Mercado
  - 5.6. Riesgo de Contraparte
  - 5.7. Riesgo de Liquidez
  - 5.8. Riesgo Estratégico
  - 5.9. Riesgo país y soberano
  - 5.10. Gobierno corporativo
  - 5.11. Prevención de lavado de activos y financiación del terrorismo
  - 5.12. Continuidad de negocio
- 6. RAZONABILIDAD DE UN SISTEMA INTEGRADO Y NO UNA GESTIÓN AISLADA**
  - 6.1. Control interno Vs. Gestión de riesgos
  - 6.2. Planeación estratégica, retos y gestión de riesgos en nuevos mercados , canales y productos
  - 6.3. Importancia y utilidad de la gestión de riesgos
  - 6.4. Principios de la gestión de riesgos
- 7. TALLER APLICADO**
- 8. TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas más Tutoría virtual 1,5 horas):**

Reflexión a partir de estudios de caso

  - 8.1. Enron
  - 8.2. Parmalat
  - 8.3. Barings Bank
  - 8.4. Estraval

**II. APLICACIÓN ESTADÍSTICA EN EXCEL A LA MEDICIÓN DE  
RIESGOS (6 horas + 1,5 horas de tutoría)**

## **ANÁLISIS DESCRIPTIVO**

- 1.1. Tipos de datos
- 1.2. Análisis descriptivo. Taller aplicado, uso e interpretación de:
- 1.3. Frecuencias
- 1.4. Medidas de tendencia central
- 1.5. Medidas de dispersión
- 1.6. Coeficiente de variación
- 1.7. Coeficiente de correlación lineal
- 2. CREACIÓN DE GRÁFICOS. TALLER APLICADO, USO E INTERPRETACIÓN EN:**
  - 2.1. Análisis de frecuencias relativa y absoluta
  - 2.2. Definición de intervalos de clase
  - 2.3. Histograma
- 3. ANÁLISIS DE DISTRIBUCIÓN POR PERCENTILES. TALLER APLICADO, USO E INTERPRETACIÓN**
- 4. ANÁLISIS Y USO DE LAS MEDIDAS DE DISPERSIÓN**
- 5. ANÁLISIS INFERENCIAL**
  - 5.1. Intervalos de confianza
  - 5.2. Pruebas de hipótesis:
  - 5.3. Aplicación en estimación de la media y proporción de la variable de interés
- 6. MODELOS DE REGRESIÓN LINEAL**
  - 6.1. Modelo Univariado
  - 6.2. Modelos Multivariados
- 7. TALLER APLICADO EN AULA VIRTUAL**

Taller de construcción, uso e interpretación de un modelo de Riesgo operacional para estimar relaciones entre los factores de riesgo y la pérdida esperada por RO
- 8. TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas):**

Aplicación de medidas de tendencia central y volatilidad en los modelos de medición de los sistemas de administración de riesgos.

## **III. ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO DE CRÉDITO** **(9 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. CONTEXTO, POLÍTICAS Y PROCESOS**
  - 1.1. ¿Qué es riesgo de crédito?
  - 1.2. ¿Cuáles factores inciden en el riesgo de crédito?
  - 1.3. ¿Cómo se pueden identificar y cuantificar los factores de riesgo de crédito?
  - 1.4. ¿Cómo se puede hacer seguimiento a la cartera, evitar y controlar el deterioro de la misma?

- 1.5. ¿Cuáles indicadores son útiles para realizar análisis de colocaciones, de calidad y evolución de la cartera de créditos?
  - 1.6. Normatividad ente regulador
  - 1.7. Etapas de la administración de riesgo de crédito
  - 1.8. Elementos mínimos con los que debe contar un Sistema de Administración de Riesgo de Crédito
  - 1.9. Riesgo de crédito en el portafolio de inversión y riesgo de crédito en la cartera de créditos.
  - 1.10. ¿Por qué un modelo interno para la gestión del riesgo de crédito? ¿Qué es y para qué sirve un modelo econométrico en la gestión del riesgo de crédito?
  - 1.11. Insumos básicos para la construcción de un modelo econométrico para la cuantificación del riesgo de crédito
  - 1.12. Características sobre el repositorio de información para construcción de modelos internos
  - 1.13. Estamentos de decisión y conflictos de interés
  - 1.14. Auditoría de políticas, procesos y procedimientos
  - 1.15. Procesos mínimos en la auditoría del sistema de administración de riesgo de crédito
- 2. TALLERES APLICADOS DE SEGUIMIENTO Y CONTROL APLICADOS A SARC**  
Alcance, uso, construcción, interpretación de resultados, información requerida, documentación, verificación implementación vs. Resultados. Formulación y validación de políticas.
- 2.1. Matrices de transición y rodamiento de la cartera en Excel
  - 2.2. Análisis de cosechas
- 3. TALLER APLICADO SISTEMAS DE PROVISIONES BAJO ESQUEMA DE PÉRDIDAS ESPERADAS**
- 4. TALLER MODELO DE APETITO DE RIESGO**
- 5. TALLER MODELO DE EVALUACIÓN Y RECALIFICACIÓN DE LA CARTERA DE CRÉDITO**
- 6. TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)** Aplicación de modelo experto de scoring de originación con metodología índices de desviación

## **IV. GESTIÓN DE RIESGO DE MERCADO** **(6 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. INTRODUCCIÓN AL RIESGO DE MERCADO Y NORMATIVIDAD**
  - 1.1. ¿Qué es riesgo de mercado?
  - 1.2. ¿Cuáles factores inciden en el riesgo de mercado?
  - 1.3. Etapas de la administración de riesgo de mercado
  - 1.4. Riesgo de Mercado para un portafolio de inversiones
  - 1.5. Valoración de Activos y su relevancia en la administración del Riesgo de Mercado
  - 1.6. Normatividad
    - 1.6.1. Elementos, políticas, límites y estructura organizacional
    - 1.6.2. Reportes, indicadores y monitoreo

- 1.6.3. Modelos y metodologías
- 1.7. Basilea y el Riesgo de Mercado
- 2. TALLER APLICADO VARIABLES RELEVANTES EN LA GESTIÓN DEL RIESGO DE MERCADO**
  - 2.1 Nivel de confianza y factor tiempo
  - 2.2 Volatilidad en activos financieros
- 3 TALLER APLICADO MÓDELOS ESTADÍSTICOS PARA VOLATILIDAD**
  - 3.1 Distribución normal vs. Distribución log-normal
  - 3.2 Modelos de Volatilidad Histórica
    - Modelos de Volatilidad EWMA
- 4 TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)**

## **V. RIESGO DE LIQUIDEZ**

### **(6 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. INTRODUCCIÓN AL RIESGO DE LIQUIDEZ Y NORMATIVIDAD**
  - 1.1 ¿Qué es riesgo de liquidez?
  - 1.2 ¿Cuáles factores inciden en el riesgo de liquidez?
  - 1.3 Etapas de la administración de riesgo de liquidez
  - 1.4 Normatividad ente regulador
    - 1.4.1 Elementos, políticas, límites y estructura organizacional
    - 1.4.2 Reportes, indicadores y monitoreo
  - 1.5 Modelos y metodologías Relevancia de los modelos estadísticos en la gestión del riesgo de liquidez
- 2. TALLER APLICADO MODELOS REGULATORIOS DE RIESGO DE LIQUIDEZ**
  - 2.1. Activos Líquidos de Mercado
  - 2.2. Indicador de Riesgo de Liquidez (IRL)
  - 2.3. Lectura e interpretación de la metodología para la toma de decisiones con base en el modelo IRL
  - 2.4. Planteamiento de supuestos aplicación e interpretación de resultados de escenarios de stress al modelo IRL
- 3. OTROS ASPECTOS NORMATIVOS DE RL**
  - 3.1. Plan de contingencia de liquidez
- 4. TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)**

## **VI. ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO OPERACIONAL**

### **(6 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. CONTEXTO Y NORMATIVIDAD RIESGO OPERATIVO**
  - 1.1 Conceptos de Sistema de Control Interno y Gobierno Corporativo
- 2. CÓMO IMPLEMENTAR SARO EN CONCORDANCIA CON LA CE 022 DEL 08 DE DICIEMBRE DE 2020**
- 3. TALLER CÓMO DESARROLLAR Y APLICAR LAS ETAPAS DE LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL**
  - 3.1. Identificación de Riesgos
  - 3.2. Cuantificación de riesgos operacionales (impacto – probabilidad)
  - 3.3. Evaluación de riesgos (Riesgo Inherente -Riesgo Residual)
  - 3.4. Análisis de Controles
  - 3.5. Matrices de riesgo operacional y mapas de riesgo
  - 3.6. Tratamiento del riesgo
  - 3.7. Monitoreo
  - 3.8. Bases de Datos
  - 3.9. Contabilización de Eventos de Riesgos
- 4. TALLER BASE DE EVENTOS DE RIESGOS**
  - 4.1. Registros de Eventos de Riesgos
  - 4.2. Fuentes de eventos de pérdida
  - 4.3. Reporte de eventos
  - 4.4. Sistemas de Incentivos
  - 4.5. Informes Gerenciales
  - 4.6. Modelos de Datos
  - 4.7. **TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)** Herramientas para la Administración del Riesgo Operativo aplicación matrices de riesgos y mapas de riesgo operacional

## **VII. PLAN DE CONTINUIDAD DE NEGOCIO**

**(3 horas + 1,5 horas de tutoría)**

- 1. ¿QUÉ ES UN PLAN DE CONTINUIDAD?**
- 2. ELEMENTOS NECESARIOS EN UN PLAN DE CONTINUIDAD**
- 3. ALCANCE DEL PLAN DE CONTINUIDAD**
- 4. ACTIVIDADES PARA IMPLEMENTAR PARA LOGRAR CONTAR CON UN PLAN DE CONTINUIDAD**
- 5. TALLER APLICADO**
- 6. TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)** identificación de riesgos de continuidad y definición de políticas

## VIII. PREVENCIÓN DE LAVADO DE ACTIVOS Y FINANCIACIÓN DEL TERRORISMO

(6 horas + 1,5 horas de tutoría)

1. **NORMATIVIDAD RELACIONADA CON LA LFT**
  - 1.1. Artículos Código Penal Colombiano La/Ft
  - 1.2. Normatividad Supersolidaria (SARLAFT)
  - 1.3. Elementos del SARLAFT
2. **MATRIZ DE RIESGO POR FACTOR DE RIESGO SARLAFT**
3. **TALLER ASPECTOS GENERALES DE LA SEGMENTACIÓN.**
  - 2.1. Conceptos Básicos
  - 2.2. Definiciones Básicas
  - 2.3. Objetivos de la Segmentación
  - 2.4. Recopilación de datos
  - 2.5. Segmentación de Clientes
  - 2.6. Segmentación de productos, canales y jurisdiccionesSeñales de Alerta
4. **RESPONSABILIDADES, ACTIVIDADES Y ROL DE OFICIAL DE CUMPLIMIENTO**
5. **MONITOREO TRANSACCIONAL**
6. **TALLER DE APRENDIZAJE AUTÓNOMO (Tiempo estimado 3,5 horas, más Tutoría virtual 1,5 horas)** Estructuración y definición e señales de alerta SARLAFT

## VII. EQUIPO DOCENTE

### **SANDRA LILIANA MATEUS SUAREZ (SIAR, SARO, SARC, SARLAFT)**

Experiencia en administración de riesgos y procesos de crédito y cartera en entidades del sector financiero, solidario y real, Máster en Banca y Finanzas del Instituto de Estudios Bursátiles, adscrito a la Universidad Complutense de Madrid, Posgrado de especialización en Estadística de la Universidad Nacional de Colombia y Economista de la misma Universidad, certificación internacional en métodos cuantitativos en administración de riesgos CQRM.

Experiencia en el diseño de metodologías para la identificación de riesgos de crédito mercado, operacional, liquidez, contraparte, estratégico, gobierno corporativo y de prevención de lavado de activos y financiación del terrorismo, así como en la construcción de modelos expertos y metodologías econométricas para su cuantificación, monitoreo y diseño de estrategias de mitigación.

He liderado equipos de reingeniería de procesos en la colocación y cobranza de crédito en las cuatro modalidades, así como en la implementación de los sistemas de administración de Riesgo operacional,

Bogotá - Colombia

crédito, mercado y liquidez en entidades oficiales especiales en Colombia, en entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia, del sector real, así como en entidades vigiladas por la Superintendencia de la Economía Solidaria.

Catedrática desde hace más de once años en posgrados de Universidades y escuelas de negocios para ejecutivos en Colombia, en Suramérica y Centroamérica, consultora internacional y conferencista de la Federación de Cooperativas Financieras en Colombia FECOLFIN y de la Superintendencia de la Economía Solidaria, en temas relacionados con la gestión integral de riesgos, gestión del Riesgo de Crédito, Riesgo Operativo, modelamiento estadístico, optimización de procesos en la originación y cobranza de la cartera de créditos y control interno, entre otros.

Conocedora desde la experiencia y desde la academia de los retos, cambio cultural y compromiso requerido para implementar procesos idóneos en fábricas de crédito, áreas de gestión de recuperación de activos y para un adecuado sistema de administración de riesgos en las organizaciones, que permita tomar decisiones estratégicas, adoptando las medidas necesarias para su mitigación, optimizando su rentabilidad y fortaleciendo su solidez y posicionamiento en el mercado. Experiencia liderando equipos de trabajo interdisciplinarios. 16 años de experiencia principalmente en entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera de Colombia y por la Superintendencia de la Economía Solidaria.

#### **ANDREY ALEXANDER GONZALEZ, CFA (SARM, SARL)**

CFA Charterholder , MBA de la Universidad de los Andes, Especialista en Estadística de la Universidad Nacional de Colombia, Especialista en Matemática Aplicada de la Universidad Sergio Arboleda y Economista de la Universidad Santo Tomás de Aquino. Gerente de fondos de inversión de Corredores Asociados del Grupo Davivienda, desarrolló herramientas de gestión para portafolios de inversión a través de modelos de optimización, metodologías de valoración de derivados financieros OTC (Over The Counter) y estrategias de arbitraje estadístico entre el mercado de derivados y el mercado spot, así como la construcción, validación y seguimiento de modelos estadísticos de riesgo de liquidez que han recibido la aprobación de la Superintendencia Financiera de Colombia. Cuenta con experiencia en investigación y análisis de los mercados financieros como Director de Análisis Económico, y en gestión de portafolios de inversión. Experiencia docente en estructuración de portafolios de inversión, modelos de optimización de inversiones, riesgo de mercado, riesgo de liquidez, modelamiento estadístico, análisis económico y derivados financieros, experiencia desarrollando modelos econométricos especialmente en Riesgo de Mercado, Riesgo de Liquidez y Riesgo de Emisor.

#### **ALLAN SANTIAGO RAMÍREZ MATEUS (ESTADÍSTICO)**

Bogotá - Colombia

Estadístico en proceso de grado de la Universidad Nacional de Colombia, con experiencia en docencia y desarrollo de monitorias enfocadas a la gestión de riesgos, en especial, desarrollo de modelos estadísticos para riesgo de crédito. Más de dos años con experiencia en programación estadística en ambientes como Python, R, SPSS o SAS y con habilidades para el análisis, estructuración y gestión de bases de datos y modelos estadísticos en la gestión de riesgos

### **PEDRO ANTONIO MOSQUERA (PLAN DE CONTINUIDAD DE NEGOCIO)**

Administrador de Sistemas de Información de la Universidad Jorge Tadeo Lozano, Especialista en proyectos de Telecomunicaciones de la universidad Politécnico Gran Colombiano, Magister en Administración de Empresas, universidad Externado de Colombia. Más de 28 años de experiencia en el campo tecnológico, especialmente en temas de planeación, gestión y administración de proyectos tecnológicos, implementación en planes de continuidad de negocio, recursos de infraestructura, auditoría, control de sistemas de información y gerencia de áreas de Tecnología tanto en el sector público como privado.

### **VIII. CRONOGRAMA**

- Las clases en tiempo real se realizarán los martes, jueves y viernes a partir del 26 de octubre 2021 hasta el día 29 de noviembre del 2021 (45 horas).
- Las sesiones de tutoría se distribuirán los lunes exceptuando feriados, en el caso de haber festivo (1 de noviembre y 15 de noviembre), estas se realizarán el sábado correspondiente (12 horas).
- Tener en cuenta que las tutorías son de opcional asistencia, sin embargo, se debe presentar al menos el 50% de las actividades para acceder a la certificación

<b>HORAS DE CLASES EN TIEMPO REAL</b>		
<b>TEMA</b>	<b>INTENSIDAD HORARIA</b>	<b>DOCENTE</b>
SIAR	3 HORAS	SANDRA LILIANA MATEUS
APLICACIÓN ESTADISTICA EN EXCEL A LA MEDICIÓN DE RIESGOS	6 HORAS	ALLAN SANTIAGO RAMIREZ
RIESGO DE CRÉDITO SARC	9 HORAS	SANDRA LILIANA MATEUS
RIESGO DE LIQUIDEZ SARL	6 HORAS	ANDREY GONZALEZ
RIESGO DE MERCADO SARM	6 HORAS	ANDREY GONZALEZ
RIESGO OPERACIONAL SARO	6 HORAS	SANDRA MATEUS
PLAN DE CONTINUIDAD DE NEGOCIO PCN	3 HORAS	PEDRO MOSQUERA
SARLAFT	6 HORAS	SANDRA LILIANA MATEUS

TUTORIA DE TRABAJO AUTÓNOMO				
MODULO	TEMA	INTENSIDAD HORARIA	DOCENTE	FECHA
1	SIAR	90 MIN	SANDRA LILIANA MATEUS	30 DE OCTUBRE
2	APLICACIÓN ESTADISTICA EN EXCEL A LA MEDICIÓN DE RIESGOS	90 MIN	ALLAN SANTIAGO RAMIREZ	6 DE NOVIEMBRE
3	RIESGO DE CRÉDITO SARC	90 MIN	SANDRA LILIANA MATEUS	8 DE NOVIEMBRE
4	RIESGO DE LIQUIDEZ SARL	90 MIN	ANDREY GONZALEZ	13 DE NOVIEMBRE
5	RIESGO DE MERCADO SARM	90 MIN	ANDREY GONZALEZ	20 DE NOVIEMBRE
6	RIESGO OPERACIONAL SARO	90 MIN	SANDRA MATEUS	22 DE NOVIEMBRE
7	PLAN DE CONTINUIDAD DE NEGOCIO PCN	90 MIN	PEDRO MOSQUERA	27 DE NOVIEMBRE
8	SARLAFT	90 MIN	SANDRA LILIANA MATEUS	29 DE NOVIEMBRE

OCTUBRE						
L	M	X	J	V	S	D
				1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	31

NOVIEMBRE						
L	M	X	J	V	S	D
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30					

## IX. PARA PARTICIPANTES EN COLOMBIA

- El valor de inversión para la participación en la totalidad de los módulos del diplomado es de \$1.400.000 + IVA - certificable
- El valor de inversión para la participación módulos individuales de 6 horas es de \$400.000 + IVA (no certificables)
- El valor de inversión para la participación módulos individuales de 3 horas es de \$300.000 + IVA (no certificables).

## X. PARA PARTICIPANTES FUERA DEL PAÍS

- El valor de inversión para la participación en la totalidad de los módulos del diplomado es de \$500 USD - certificable
- El valor de inversión para la participación módulos individuales de 6 horas es de \$150 USD (no certificables)
- El valor de inversión para la participación módulos individuales de 3 horas es de \$100 USD (no certificables)

### NOTA:

- a. Dos o más participantes de una misma entidad tendrán cada uno un descuento del 7%.
- b. Miembros de la Comunidad UdeRiesgos a través de membresía tienen un descuento del 7%

### C. Descuentos no acumulables

## XI. INSCRIPCIONES

Las inscripciones podrán realizarse en el siguiente link:  
[https://app.getresponse.com/site2/diplomado\\_siar\\_enfoque\\_tecnico/?u=BG0b&webforms\\_id=hy5yN](https://app.getresponse.com/site2/diplomado_siar_enfoque_tecnico/?u=BG0b&webforms_id=hy5yN)  
Después de realizada la inscripción, el participante recibirá un correo de confirmación enviando el link para pago o numero de cuenta para transferencia electrónica; así como la solicitud de documentación, en caso de ser necesario, para el envío de la factura electrónica.

También se podrán realizar las inscripciones en el correo [admin@uderiesgos.com](mailto:admin@uderiesgos.com), enviando los siguientes datos:

#### Datos del participante

- ✓ Nombre participante
- ✓ Número de identificación
- ✓ Correo electrónico
- ✓ Número de teléfono

#### Datos para facturación

Facturación a nombre propio	Facturación a nombre de empresa
Nombre completo	Rut de la empresa
Número de identificación	Teléfono
dirección de residencia	Correo y teléfono de la persona encargada de facturación
Teléfono de contacto	
Correo electrónico	

## XII. ESPECIFICACIONES DEL VALOR DE LA INVERSIÓN

- UDERIESGOS S.A.S. emitirá la respectiva certificación del curso a los participantes que cumplan con al menos el 80% de la intensidad horaria.
- Para las sesiones UDERIESGOS S.A.S. pondrá a disposición la plataforma virtual para desarrollar la capacitación, evento en el cual los participantes deben contar con su respectiva laptop y demás componentes para interactuar por este medio.
- Las sesiones quedarán grabadas y estarán disponibles por un periodo de 15 días posteriores a la realización de cada sesión para consulta del participante en caso de requerirse.
- El material desarrollado como presentaciones en PPT y ejercicios académicos desarrollados en Excel serán puestos a disposición del participante.

- Para participantes en Colombia el valor total corresponde a los valores antes citados + IVA
- Para participantes fuera del país el valor corresponde a los valores antes citados + impuestos y costos de transferencia, de acuerdo con la legislación local vigente.
- El pago e inscripción del curso deberá realizarse máximo 2 días antes de iniciar el evento o módulo según corresponda.
- Para realizar la inscripción del diplomado, se deberá realizar el proceso de inscripción en el link de la sección inscripciones, en la página [www.uderiesgos.com](http://www.uderiesgos.com), o en el correo [admin@uderiesgos.com](mailto:admin@uderiesgos.com). Posteriormente, se emitirá una factura que se pagará en la cuenta de ahorros 69193760392 de Bancolombia a nombre de UdeRiesgos SAS, vía Payu, o vía Paypal (si se escoge esta opción, por favor indicarla al momento de la inscripción para la generación de un link único de pago)
- Grupos mayores o igual a 2 personas de la misma entidad tendrán un descuento del 7 %
- Usuarios activos de la membresía de UdeRiesgos tendrán un descuento del 7 % Descuentos no acumulables
- El valor del diplomado incluye una certificación expedida por UdeRiesgos.
- La certificación será expedida en formato físico para los inscritos en Colombia, y virtual para inscritos en el extranjero. El costo del envío de la certificación fuera de Bogotá será asumido por el participante, o enviada virtualmente bajo previa solicitud.
- Oferta del diplomado sujeta a número mínimo de inscritos. En caso de no obtenerse, se hace devolución de los recursos en los siguientes 5 días hábiles.
- Una vez iniciado el diplomado o los módulos, no se realizará devolución del dinero.

### XIII. BIBLIOGRAFÍA

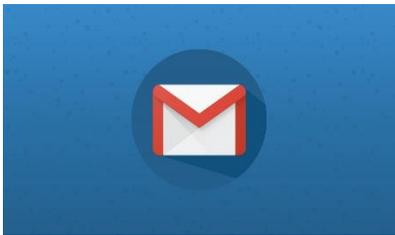
- CE 022 del 28 de diciembre de 2020 de la SES
- Administración del Riesgo Empresarial. Estructura Integrada Resumen Ejecutivo. Committee of Sponsoring Organizations of the Treadway Commission - Septiembre 2004. Traducción y Adaptación (no oficial) con propósitos académicos Por Ulises Guardiola R. Octubre 2004 Member IIA Colombia
- Anderson Rolph, Black William, Hair Joseph, Tatham Ronald. Análisis Multivariante. Prentice Hall, Madrid, 1999.
- AS/NZS 4360:1999. Estándar Australiano. Administración de Riesgos
- Banco de Pagos Internacionales. Principios para la adecuada gestión y supervisión de liquidez. Comité de Supervisión Bancaria de Basile. 2008
- Christian Andrew Johnson, Métodos de evaluación del riesgo para portafolios de Inversión, Banco Central de Chile. 2000
- Circular 048/049 de 2006. Superintendencia Financiera de Colombia.
- COSO (2005) Control Interno - Estructura conceptual integrada. Cuarta edición. Ecoe Ediciones: Bogotá (Traducción del The COSO Report)

- Elizondo Alan, Medición integral del Riesgo de Crédito. Edit. Limusa, 2003.
- Estándares de Gerencia de Riesgos. Ferma
- Estupiñan Gaitán, Rodrigo. Administración o Gestión de Riesgos ERM y la auditoría Interna. Ecoe Ediciones Ltda. 1° edición. Bogotá, DC. 2006.
- Hosmer David W, Lemeshow Stanley, Applied logistic regression. John Wiley & Sons Inc. Vilariño Sanz Ángel, Turbulencias Financieras y Riesgos de Mercado. Prentice Hall. 2001.
- Integrated Risk Management. Implementation Guide. Canada
- Lara Haro Alfonso. Medición y control de riesgo financiero. Ed. Limusa. 3ª. Ed.
- Mejía Quijano, Rubi Consuelo. Administración de Riesgos. Un enfoque Empresarial. Fondo Editorial Universidad Eafit. 1° edición. Medellín. 2006..
- Miguel Delfiner, Liquidity Risk Management in Banks: international best practices and cases. Banco Central de Argentina. 2006
- Montgomery Douglas C, Peck Elizabeth. Introduction to linear regression analysis. John Wiley & Sons Inc. 1992.
- NTC 5254. Gestión del Riesgo.
- Phillipe Jorion. Manual de riesgo financiero. Ed. John Willey & Soons. 2000.
- Rodríguez Taborda Eduardo, Administración del Riesgo. Alfaomega editores enero de 2002.
- Sarbanes Oxley Act de Julio de 2002.
- SPSS para-Windows. Ed. Mc Graw Hill.
- Vilariño Angel. Turbulencias financieras y Riesgos de Mercado. Ed. Prentice Hall 2001.
- CE007 de 1996 específicamente en su capítulo 11
- Recomendaciones internacionales sobre LAFT



# de Riesgos.com

## CONTÁCTENOS



- [SMATEUS@UDERIESGOS.COM](mailto:SMATEUS@UDERIESGOS.COM)
- [ADMIN@UDERIESGOS.COM](mailto:ADMIN@UDERIESGOS.COM)
- 3207506379
- 3203362119
- 3105627267

**UDERIESGOS SU ALIADO EN  
GESTIÓN DE RIESGOS  
FINANCIEROS Y NO FINANCIEROS**

- ✓ **CONSULTORIAS Y ASESORÍAS**
- ✓ **DIPLOMADOS**
- ✓ **ENTRENAMIENTO EN CAMPO**
- ✓ **CAPACITACIONES**
- ✓ **CURSOS PRESENCIALES Y VIRTUALES**



[www.uderiesgos.com](http://www.uderiesgos.com)