

SEMINARIO – TALLER APETITO Y TOLERANCIA AL RIESGO DE LIQUIDEZ

Aplicación y uso de métodos estadísticos para el análisis e identificación del riesgo de liquidez.

Construcción y validación de modelos para identificar y medir el riesgo de liquidez

Definición del apetito y tolerancia al riesgo de liquidez



Pilares
consultores

Objetivo general

- Transmitir los conceptos claves y las herramientas estadísticas, econométricas y analíticas básicas y necesarias para la construcción, uso, monitoreo y calibración de modelos para medir el riesgo de liquidez y determinar el apetito y tolerancia de riesgo de liquidez.

Objetivos específicos

- Conocer las razones por las cuales la planeación, organización y control del riesgo de liquidez impacta de forma directa en los resultados de la gestión.
- Suministrar los elementos necesarios para identificar y medir mediante métodos cuantitativos el riesgo de liquidez.
- Contar con lineamientos que permitan analizar los límites de liquidez y herramientas para el seguimiento del riesgo de liquidez.
- Evaluar el establecimiento de métricas efectivas para la administración del riesgo de liquidez.
- Definir la cantidad de exposición al riesgo que la Entidad esta dispuesta a aceptar y/o retener para el logro de sus objetivos estratégicos.

Metodología

- La metodología es teórica 30% - práctica 70%.
- Las actividades teóricas expondrán las técnicas y procedimientos que se requieren para la parte práctica.
- La parte práctica se basará en modelos con datos simulados para aplicar las metodologías.

Auditorio

- Comité de Riesgos
- Gerentes Generales
- Gerentes Financieros
- Gerentes de Riesgos
- Gerentes Comerciales
- Auditores Internos
- Contadores Generales
- Otros funcionarios

marzo de 2020

CAPACITACIÓN@PILARESCONSULTORES.COM



Temario

1. Lineamientos internacionales
 - COSO ERM - 2017
 - ISO 31000:2018
 - Basilea: Buenas prácticas
 - Otros lineamientos
2. Nuevas tendencias en la regulación
 - Basilea III y las buenas prácticas internacionales
3. Definición de Apetito y Tolerancia al Riesgo de Liquidez

Temario

4. Modelos de corto plazo

- Proyecciones de flujo de caja
- Ratio de fondeo estable

5. Modelos de largo plazo

- Modelación de principales partidas de vencimiento contractual

6. Análisis de estrés

7. Pruebas de tensión

Temario

7. Casos de estudio

- Concentración Gini Lorenz
- Flujo de caja
- Liquidez intradía

Equipo necesario

- Computadora portátil que será utilizado en el evento de capacitación
- En el taller, se instalará software con licencia temporal que será utilizado en la resolución de casos

Ficha del Curso

- Ciudad: Cochabamba
- Lugar: [Hotel Regina](#)
- Dirección: Calle Chuquisaca N° 359 entre Av. Ballivián y España
- Fechas: desde el jueves [12/03/2020](#) al viernes [13/03/2020](#)
- Horarios: [8:30 – 12:30](#) y [14:00 – 18:00](#)
- Costo: [Bs1.450](#) por persona
 - (descuento 10% por pronto pago antes del [11/03/2020](#))
- Para inscribirse llenar la [Ficha de Registro](#):
- Envío del ARCHIVO EXCEL de la Ficha de Registro a: capacitacion@pilaresconsultores.com

Plano de ubicación



marzo de 2020

CAPACITACIÓN@PILARESCONSULTORES.COM



www.pilaresconsultores.com

capacitacion@pilaresconsultores.com



788-99-888 / 703-44-029

marzo de 2020

CAPACITACIÓN@PILARESCONSULTORES.COM



12