

Diplomado online en Gestión de riesgos con énfasis en SARLAFT



[VIGILADA MINISTERIO DE EDUCACIÓN, RES. 1220 DE 2016]

Presentación

El diplomado permite conocer y apropiarse las prácticas actuales de la gestión de riesgo en cuanto a la prevención y control de lavado de activos, así como lo relacionado con la financiación del terrorismo conforme lo establecen las circulares expedidas por las Superintendencias Financiera, de Sociedades, Nacional de Salud, de la Economía Solidaria, de Notariado y Registro, de Vigilancia y Seguridad Privada, de Puertos y Transporte, la DIAN, el Ministerio de las TICs, Coljuegos, Coldeportes y el CNJSA y las Resoluciones expedidas por la Unidad de Información y Análisis Financiero UIAF.

Por otra parte, la liberalización y globalización de los servicios financieros y de la economía, la creciente sofisticación tecnológica, y la desnarcotización del lavado de activos y la financiación del terrorismo están haciendo cada vez más diversos los delitos fuente y por consiguiente se presenta una mayor complejidad en la elaboración de los perfiles de riesgo de las compañías, empresas, organizaciones e instituciones que componen los sectores económicos en Colombia.

Teniendo en consideración que el desarrollo de sistemas de riesgo requiere un recurso humano capacitado y actualizado en el manejo de metodologías, técnicas y herramientas que les permita administrar en forma efectiva los diferentes sistemas: procesos, gestión, control y gobierno de manera integral desde la perspectiva de riesgo, sumados a los componentes actuales que vive el mundo globalizado con respecto a los riesgos asociados al narcotráfico, lavado de activos y financiación del terrorismo, se ofrece este programa para potenciar, suplir y apoyar a las instituciones que así lo requieran.

Dirigido

Directivos, empleados y profesionales vinculados con empresas sometidas a la obligación de adoptar un sistema para la prevención de los riesgos de Lavado de Activos y Financiación del Terrorismo: SIPLA, SIPLAFT, SARLAFT,

**Centro de Consultoría
& Educación Continua**

Informes: ☎ 3104994392 ☎ 3218200 /opción 4
formacion@javerianacali.edu.co

SAGRLAFT; funcionarios, empleados, auditores, revisores fiscales, oficiales de cumplimiento, analistas de cumplimiento e integrantes de comités de riesgos de entidades y empresas sujetas a la autoridad de la Superintendencia Financiera, la Superintendencia de Sociedades, la Superintendencia de Puertos y Transporte, la Superintendencia Nacional de Salud, la Superintendencia de Notariado y Registro, la Superintendencia de Vigilancia y Seguridad Privada, Coljuegos, Coldeportes, Consejo Nacional de Juegos de Suerte y Azar, la Superintendencia de la Economía Solidaria, la Dirección de Impuestos y Aduanas Nacionales – DIAN, el Ministerio de las TIC, y la Unidad de Información y Análisis Financiero- UIAF.

Metodología

El diplomado se desarrollará mediante clases magistrales combinadas con ejercicios y talleres prácticos y análisis de casos reales. Será ampliamente participativo e ilustrativo, con profesores que tienen amplia experiencia en el tema y se han desempeñado como oficial de cumplimiento.

Horario

Las sesiones online se desarrollarán los días viernes de 5:00 a 9:30 p.m. y sábados de 8:00 a.m. a 1:30 p.m.

Inversión

El valor de la inversión es de \$2'500.000.

Logros

El participante al finalizar este diplomado estará en la capacidad de:

- Contribuir a la creación de la cultura de administración y gestión del riesgo al interior de las diferentes organizaciones de los participantes

- Apropiarse de los conocimientos sobre los instrumentos teóricos y prácticos que permitan implementar una adecuada identificación, medición, control, monitoreo y comunicación del riesgo
- Desarrollar competencias que le permita construir e implementar métodos de administración del riesgo integrados con los sistemas de procesos, riesgos, control y gobierno corporativo

Contenido

Introducción a la teoría del riesgo y diseño del sistema de gestión de riesgos

- Concepto general y definición de riesgo.
- El sistema de gestión de riesgos y el control interno
- Principios de la gestión del riesgo
- Diseño de un marco de referencia de la gestión de riesgo (ISO 31000)
- Implementación del marco de referencia
- Definición de riesgos inherentes y riesgos residuales
- Definición de apetito de riesgo y niveles de tolerancia
- Metodología para identificación de riesgos, causas y consecuencias
- Metodología para la parametrización de la probabilidad e impacto
- Metodología para evaluar el diseño y eficacia de los controles
- Elaboración de mapas de riesgos inherentes y residuales
- Matrices de eventos de riesgo

Sistema de administración del riesgo de lavado de activos y de la financiación del terrorismo (Sarlaft)

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

16. Programas de cumplimiento - identificación de vulnerabilidades en la organización
17. Operaciones normales versus Operaciones Inusuales
18. Diferencia entre señales de alerta y operaciones inusuales
19. Metodología para detección de operaciones sospechosas
20. Casos reales de lavado de activos, detección y reporte
21. Mapa de riesgo enfocado a SARLAFT
22. Evaluación de los controles SARLAFT (Monitoreo)
23. Factores de riesgo (Análisis)

Bases estadísticas para el análisis cuantitativo de riesgos enfocado al SARLAFT

- Introducción y definición de análisis cuantitativo en riesgos
- Identificación de segmentos de riesgo con algoritmos de clustering e inteligencia artificial
- Reportar adecuada y anticipadamente transacciones sospechosas, según los modelos



Pontificia Universidad
JAVERIANA
Cali

[VIGILADA MINISTERIO DE EDUCACIÓN, RES. 1220 DE 2016]

- Identificar y caracterizar transacciones y eventos inusuales y/o sospechosos de fraude
- Encontrar variables sensitivas en riesgo operativo para proyección de pérdidas
- Talleres y casos prácticos enfocados en el SARLAFT.

Sistema de administración del riesgo operativo

- Fuentes del riesgo operativo
- Técnicas para la medición y cuantificación del riesgo operativo
- Etapas de la administración del riesgo operativo
 - Identificación
 - Medición
 - Control
 - Monitoreo
- Elementos del Sistema de Administración de Riesgo Operativo - SARO
- Marco legal aplicable a los sectores
- Aspectos clave de la circular 25 del 7 de julio de 2020.
- Talleres y casos prácticos.

Riesgo de mercado

- Introducción y definición de riesgo de mercado. (Perfil del riesgo de mercado, tipo y clasificación de las inversiones, factores de riesgo de mercado)
- Etapas de la administración del riesgo de mercado.
- Elementos del riesgo de mercado.
- Riesgo de tasa de interés.
- Riesgo de tipo de cambio.
- Gestión del riesgo de mercado.
- Clasificación de inversiones.
- Medición del Riesgo de Mercado
- VaR (Value at Risk)
- Definición
- Conceptos fundamentales
- Repasos de herramientas estadísticas
- Tendencia central

**Centro de Consultoría
& Educación Continua**

Informes: ☎ 3104994392 ☎ 3218200 /opción 4
formacion@javerianacali.edu.co

- Cálculo de volatilidades
- Correlaciones.
- Talleres y casos prácticos enfocados en el SARLAFT.

Riesgo de crédito

- Conceptos y generalidades del SARC
- Evaluación del riesgo de crédito
- Gestión del riesgo de crédito: Ciclo integral del riesgo de crédito
- Indicadores del riesgo de crédito (Scoring, variables macroeconómicas y el ciclo de tesorería)
- Diferencias entre riesgo de crédito de personas y empresas
- Seguimiento y mantenimiento
- Recuperación de ventas de cartera
- Medición del riesgo de crédito, su impacto económico.
- Metodología para cuantificar el impacto del ciclo (Monitoreo, Control y Mitigación)
- Talleres y casos prácticos sobre todos los temas abordados.

Riesgo de liquidez

- Marco legal
- Introducción
- Riesgo de liquidez
- Generalidades
- Concepto
- Riesgo de liquidez de mercado
- Liquidez asociada a fondos (incluye fondos de empleados)
- Liquidez asociada a riesgo de crédito
- Relación entre riesgo de liquidez, crédito y mercado
- Gestión del Riesgo liquidez.
- Identificación
- Medición del Riesgo de liquidez
- Brechas de liquidez (GAPs)
- IRL
- ALM (Assets and liabilities management)
- LaR (Liquidity at risk)

- Monitoreo y control
- Plan de contingencia de liquidez
- Stress test de liquidez
- Mitigación
- Talleres prácticos sobre todos los temas abordados.

Diseño de planes de emergencia y contingencia

- Definición y concepto de la administración de la continuidad del negocio
- Procedimientos y metodologías
- Prevención y atención de emergencias
- Administración de crisis
- Planes de contingencia y continuidad
- Capacitación y divulgación de información
- Talleres prácticos sobre todos los temas abordados