

TÉRMINOS DE REFERENCIA

SERVICIO DE CAPACITACIÓN SIMULADOR DE GESTIÓN ESTRATÉGICA DE RIESGOS

I. OBJETIVOS

Objetivo general

Dotar a los participantes de capacidades de análisis y herramientas, para crear mayor conciencia sobre los diferentes tipos de exposiciones a riesgos que cualquier institución financiera enfrenta, así como tener mayores conocimientos acerca de las principales metodologías para su gestión. Los participantes aprenden los principios de la identificación, análisis y control de los diversos riesgos, tomando decisiones considerando la disyuntiva entre riesgos y oportunidades en un entorno simulado.

Objetivos específicos

- Conocer la gestión de una institución bancaria con un enfoque en riesgos
- Analizar e interpretar correctamente información financiera, operativa y de riesgos para la toma de decisiones
- Analizar los resultados e interpretar correctamente reportes de los principales riesgos financieros que enfrente una institución bancaria
- Considerar factores e interrelaciones entre la posición de riesgo de la institución financiera, tendencias macroeconómicas y la posición y estrategia de la competencia
- Tomar conciencia acerca del manejo de los riesgos operativos
- Conocer la gestión de riesgos relevantes en base a Basilea III
- Tener conciencia de la importancia de contar con un plan estratégico que guíe la toma de decisiones en la institución
- Desarrollar capacidades para trabajo en equipo orientado a metas específicas, en un ambiente altamente competitivo y con restricciones de tiempo
- Obtener conocimientos y capacidades específicas que pueden ser utilizados en el trabajo diario

II. METODOLOGÍA

Las clases se realizarán de manera presencial y con la utilización de una metodología lúdica e interactiva que permitirá a los participantes simular la toma de decisiones.

Se formarán equipos que representarán a las instituciones financieras que entrarán a competir durante varias rondas, en las cuales se presentarán una serie de variables para que los equipos por separado puedan tomar decisiones, las cuales deben ser ingresadas en el software del simulador. Al final de cada ejercicio habrá un equipo que lidere el juego como resultado de sus decisiones.

III. PÚBLICO OBJETIVO

La capacitación será desarrollada para un número aproximado de treinta y cinco (35) participantes del XXIV Programa de Extensión; considerando el dictado de treinta y dos (32) horas lectivas.

IV. REQUISITOS DEL POSTOR

El postor deberá ser una institución de prestigio internacional que cuente con experiencia en actividades de capacitación en el ámbito de la gestión financiera, incluyendo simulaciones computarizadas, durante al menos los últimos 10 años.





SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

V. REQUISITOS DEL EQUIPO DE TRABAJO

El postor deberá presentar un equipo de trabajo que estará conformado por dos expertos internacionales en Riesgos presentes en todo el evento

El coordinador deberá contar con un mínimo de tres (03) años de experiencia en labores de coordinación en entidades educativas a nivel universitario, tales como asistencia de los participantes, entrega de materiales, entrega y aplicación de exámenes, entrega de resultados, la coordinación de los profesores y alumnos y resolver cualquier situación que se presente durante el desarrollo del curso.

La experiencia del personal propuesto se acreditará mediante la presentación de (i) contratos con su respectiva conformidad, (ii) constancias, (iii) certificados o (iv) cualquier otro documento que, de manera fehaciente, demuestre el tiempo de experiencia del profesional propuesto.

VI. LUGAR

La capacitación se impartirá en las instalaciones del Centro de Formación de la SBS, sito en Av. Guillermo Prescott N° 160, San Isidro.

VII. PLAZO DE CONTRATACIÓN

El curso se desarrollará los días 6,7,8 y 9 de marzo teniendo una duración de treinta y dos (32) horas lectivas, y dictándose clases de lunes a jueves en el horario de 8:30 a.m. a 06:00 p.m. Este horario podrá modificarse previa coordinación con el Departamento de Capacitación.

VIII. DISEÑO ACADÉMICO DEL CURSO

El curso se llevará bajo la modalidad presencial, en el cual se expondrán los temas indicados a continuación.

Día 1

Introducción al taller:

- Introducción general al simulador
- Concepto de diferentes riesgos
- Efectos de riesgos en la rentabilidad
- Decisiones e interrelaciones en el simulador
- Análisis del contenido del manual y materiales
- Establecimiento de las reglas del simulador
- Explicación de cómo usar el software del participante

Explicación de la Fase 1 (Recuperación económica)

Ronda 1 – Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de crédito
- Fluctuación de personal / riesgo de personal
- Riesgo de capacidad
- Riesgos operacionales
- Presentación de resultados ronda 1
- Discusión de resultados





SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

Día 2

Rondas 2 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de crédito
- Fluctuación de personal / riesgo de personal
- Riesgo de capacidad
- Riesgos operacionales
- Presentación de resultados ronda 2
- Discusión de resultados
- Introducción al tema de manejo de personal en el simulador

Explicación de la Fase 2 (Auge económico)

Ronda 3 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de concentración de créditos
- Riesgo de tasa de interés
- Riesgo de procesamiento interno
- Riesgo de desastres naturales
- Presentación de resultados ronda 3
- Discusión de resultados
- Introducción al tema de inversiones y opciones de refinanciamiento en el simulador

Día 3

Ronda 4 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de concentración de créditos
- Riesgo de tasa de interés
- Riesgo de procesamiento interno
- Riesgo de desastres naturales
- Presentación de resultados ronda 4
- Discusión de resultados

Explicación de la Fase 3 (Recesión económica)

Ronda 5 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de precios
- Riesgo cambiario
- Riesgo de liquidez
- Riesgo IT
- Riesgo de reputación
- Presentación de resultados ronda 5
- Discusión de resultados

Día 4

Ronda 6 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de precio de mercado
- Riesgo cambiario
- Riesgo de liquidez
- Riesgo IT
- Riesgo de reputación
- Presentación de resultados ronda 6

Explicación de la Fase 4 (Recuperación económica)

Ronda 7 - Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de crédito

Los Laureles N° 214 - Lima 27 - Perú Telf.: (511) 6309000 Fax: (511) 6309204





SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

- Riesgo de precios
- Riesgo de liquidez
- Riesgo corrupción/fraude
- Riesgo estratégico
- Presentación de resultados ronda 7
- Discusión de resultado

Ronda 8 (con posibilidad de realizarlo, dependiendo del avance de los días anteriores)

Principales riesgos a considerar:

- Riesgo de crédito
- Riesgo de precios
- Riesgo de liquidez
- Riesgo de corrupción / fraude
- Riesgo estratégico
- Presentación de resultados ronda 8
- Discusión de resultados

Cierre del taller:

- Presentaciones finales de resultados de los grupos participantes
- Conclusiones del evento
- Evaluación de participantes
- Entrega de certificados de participación

IX. ENTREGABLES

Informe final

El informe final deberá dar alcances sobre el desarrollo del curso, de sus participantes y sobre sus principales resultados, el mismo que deberá ser entregado dentro de 5 días útiles posteriores a la fecha de la evaluación final

X. FORMA DE PAGO

El pago de la contraprestación se realizará al finalizar el curso, luego de la recepción formal y completa de los entregables, previa conformidad de la Gerencia de Gestión Humana.

