

Curso con expositor internacional impartido por
Bursen - Centro de Estudios Financieros con respaldo de la
Bolsa de Valores de Lima



GESTIÓN ESTRATÉGICA DE RIESGOS FINANCIEROS

inteligencia artificial,
modelos y herramientas

Fechas 5, 6, 7, 8 y 12 de octubre, 2026

Hora 18:00 a 21:00

Modalidad virtual, vía Zoom



Objetivo

El curso brindará modelos cuantitativos e instrumentos analíticos para la identificación, medición, control y monitoreo de los riesgos de mercado, crédito, tasas de interés y liquidez, en estricto cumplimiento con estándares de supervisión financiera y las mejores prácticas bursátiles. Asimismo, se capacitará en el uso práctico e inteligente de herramientas de Inteligencia Artificial Generativa (IA) para la automatización de código cuantitativo, la construcción de indicadores clave (KRI) y la optimización de la reportería ejecutiva para el comité de riesgos y el directorio.

CURSO INTERNACIONAL

Expositor



Hernando Porras

***Presidente de
ASORIESGO - Asociación
de Profesionales
Especialistas en Riesgo***

***Líder Estratégico en Altas
Finanzas y Gestión Integral
del Riesgo.***

Directivo y consultor de nivel C-Suite con más de 30 años de experiencia en estrategia financiera, gestión de riesgos y dirección ejecutiva en bancos, fiduciarias, comisionistas de bolsa, entidades públicas y el sector solidario en Colombia.

Fue Director de Riesgos del Banco Popular de Colombia y Jefe de la División de Análisis y Evaluación de Riesgos del Ministerio de Hacienda y Crédito Público de Colombia.

Conferencista internacional y profesor de Doctorado en la Universidad EAN y de Maestría en la Universidad del Rosario, Colombia.

Economista, PhD en Administración por la Universidad Externado de Colombia y MBA por EADA Business School (España) y PUCP (Perú).

Cuenta con amplia experiencia en gestión de riesgos de mercado, liquidez, crédito y riesgo reputacional, así como en modelos cuantitativos avanzados, derivados financieros y herramientas de cobertura.

Dirigido a

- Funcionarios de alta gerencia, encargados de riesgos, inversiones, operaciones y encargados de las unidades de auditoría interna en agencias de bolsa, sociedades administradoras de fondos de inversión, sociedades de titularización, compañías de seguro y de la Gestora Pública, así como otras instituciones financieras y participantes del mercado de valores.
- Funcionarios de la Bolsa Boliviana de Valores y Entidad de Depósito de Valores y todo funcionario interesado en el tema, de las entidades mencionadas.

Sesión 1: Gobernanza del Riesgo, Marco de Apetito (RAS) y Supervisión Prudencial.

- Arquitectura GIR.
- Marco de Apetito al Riesgo (RAS).
- Ciclo de Gestión.
- Supervisión Basada en Riesgos.

Sesión 2: Matrices de Riesgo, Evaluación de Controles y KRIs Asistidos por IA.

- Mapeo Cualitativo-Cuantitativo.
- Evaluación e Impacto (Heat Maps).
- Efectividad de Controles.
- KRIs e Inteligencia Artificial Integrada.

Sesión 3: Modelación del Riesgo de Mercado: VaR, Expected Shortfall y Código con IA.

- Factores de Mercado.
- Modelación de Value at Risk (VaR).
- Expected Shortfall (ES).
- Validación de Modelos y Código con IA.

Sesión 4: Riesgo de Crédito, Análisis Acelerado con IA y Riesgo de Tasas (IRRBB).

- Componentes de Crédito.
- Pérdidas y Concentración.
- Análisis Cualitativo Acelerado de Deudores con IA.
- Riesgo de Tasas de Interés en el Libro Bancario (IRRBB).

Sesión 5: Riesgo de Liquidez, Stress Testing y Caso Integrador con Reportería IA.

- Riesgo de Liquidez.
- Pruebas de Estrés (Stress Testing).
- Caso Integrador de Gestión.
- Automatización de Reportería con IA.

Total: 15 horas

Acerca de la ABAV

Somos la voz autorizada que representa a las agencias de bolsa y sociedades administradoras de fondos de inversión (SAFI), con el objetivo de desarrollar el mercado de valores en Bolivia, brindar capacitación y difundir su conocimiento.

Incluye material y certificado de participación otorgado por Bursen y BVL x nuam

Inversión

Tipo de participante	Por persona	Por persona para grupos a partir de 6
Afiliados	Bs 2.900	Bs 2.700
No afiliados	Bs 3.500	Bs 3.300
Estudiantes	Bs 700	N/A

Pago por ransferencia bancaria a la cuenta M/N 1000206829 del Banco Nacional de Bolivia S.A. a nombre de la ABAV.

Inscripciones hasta el 30 de septiembre - Plazas limitadas



Mayor información y consultas:

NICOLA AYLLÓN
nicolayllon@abav.com.bo
+59172000089

www.abav.com.bo