



Instituto Iberoamericano  
de Mercados de Valores



## Jornadas sobre supervisión basada en riesgo

Centro de Formación de la AECID en Cartagena de Indias, Colombia  
Del 16 al 18 de noviembre de 2016

### Miércoles 16 de noviembre

- 08:30 Traslado desde Hotel Hilton al Centro de Formación
- 09:00 Recepción de participantes, entrega de material
- 09:10-09:20 Apertura:  
- Mercedes Flores, Directora del Centro de Formación de la Cooperación Española de Cartagena de Indias  
- Santiago Cuadra, Secretario General del IIMV
- 09:25 -10:20 **El Modelo de supervisión basada en riesgos en el Banco de España**  
Ana M<sup>a</sup> Martínez, Responsable de la Unidad de Procedimientos y Metodología de la Dirección General de Supervisión del Banco de España
- 10:20-11:15 **La metodología de análisis de riesgo en la SVS de Chile, aplicada a intermediarios y a la gestión de fondos**  
Hernan López, Intendente de Supervisión del Mercado de Valores de la SVS Chile
- 11:15 -11:30 Pausa café
- 11:35-12:30 **Modelo de Supervisión basada en riesgos (SBR) de la CNMV de España**  
Pedro Blanco, Técnico de Supervisión de Empresas de Servicios de Inversión del Departamento de Supervisión de E.S.I. y E.C.A. Dirección General de Entidades de la CNMV de España.
- 12:35-13:30 **Modelo y metodología de análisis de riesgo en Perú**  
Mario Zambrano, Superintendente Adjunto de Riesgos de la SMV del Perú
- 13:30-14:30 Almuerzo
- 14:30-15:15 **Estándares internacionales de gestión de riesgo**  
Angela Viviana Garcia Rios, Contador Público. Panama
- 15:15-16:00 **Marco de Supervisión Basada en Riesgos: criterios de Evaluación y metodología de análisis de riesgo en la CNBV**  
Jorge Jimenez, Director General Adjunto de la Dirección General de Supervisión de Entidades Bursátil de la CNBV México

- 16:00-16:15 Pausa café
- 16:15-17:00 **Situación de SBR en Panama comparada con otros países del entorno**  
Angela Viviana Garcia Rios, Contador Público. Panama
- 17:05 Traslado desde el Centro de Formación al Hotel Hilton

#### **Jueves 17 de noviembre**

- 08:30 Traslado desde Hotel Hilton al Centro de Formación
- 09:00-10:00 **Aspectos prácticos de la Supervisión de la actividad bancaria bajo el Enfoque Riesgo**  
Ana M<sup>a</sup> Martínez, Responsable de la Unidad de Procedimientos y Metodología de la Dirección General de Supervisión del Banco de España
- 10:05-11:05 **Experiencia chilena en extender el enfoque de SBR a actividades reguladas no propiamente financieras (emisores, clasificadores, y auditores). Desafíos de esta estrategia**  
Hernan López, Intendente de Supervisión del Mercado de Valores de la SVS de Chile
- 11:10-11:30 Pausa café
- 11:30-12:30 **Casos prácticos de supervisión de conglomerados, financieros y no financieros**  
Mario Zambrano, Superintendente Adjunto de Riesgos de la SMV del Perú
- 12:30-13:30 **Casos prácticos de Supervisión de las Empresas de Servicios de Inversión**  
Pedro Blanco, Técnico de Supervisión de Empresas de Servicios de Inversión del Departamento de Supervisión de E.S.I. y E.C.A. Dirección General de Entidades de la CNMV de España.
- 13:30-14:30 Almuerzo
- 14:30-15:15 **Casos prácticos de Supervisión basada en riesgos en México**  
Jorge Jimenez, Director General Adjunto de la Dirección General de Supervisión de Entidades Bursátiles de la CNBV México
- 15:15-16:00 **Caso de Estudio: Uso de herramientas de código abierto en el Análisis de Riesgos en República Dominicana**  
Stefan Bolta, Encargado de la División de Análisis de Riesgo y Estudios Económicos de la SIV Rep Dominicana
- 16:00 -16:15 Pausa café
- 16:15-17:00 **Enfoque de la Supervisión Basada en Riesgo en Colombia**  
Juan Carlos Alfaro, Superintendente Delegado para Supervisión de Riesgos y Conductas de Mercad. SFC de Colombia
- 17:05 Traslado desde el Centro de Formación al Hotel Hilton

## Viernes 18 de noviembre

- 08:30 Traslado desde Hotel Hilton al Centro de Formación
- 09:00-10:00 **Casos prácticos de supervisión a Casas Bolsa en México**  
Rocio Toquiantzi Huerta, Director de Entidades e Intermediarios Bursátiles Mexico. CNBV México
- 10:00-10:15 Pausa café
- 10:20-11:20 **Casos prácticos de SBR en Colombia**  
Juan Carlos Alfaro, Superintendente Delegado para Supervisión de Riesgos y Conductas de Mercado. SFC de Colombia
- 11:25-12:00 Coloquio, clausura y fin de Jornada
- 12:30 Almuerzo