



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha:

23

05

19

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. ÁREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA ASESORÍA :	Gerencia de Operaciones Internacionales
SUBGERENCIA :	
DEPARTAMENTO :	Departamento de Control de Inversiones

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	Rodolfo Soto Camacho		
NOMBRE DEL EVENTO :	Seminario sobre la Gestión de Riesgos Financieros en los Bancos Centrales		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 06 / 05 / 2019	AL: 10 / 05 / 2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO: Madrid - España
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	3550.05	COSTO DE PASAJES (Bs).	11642.55

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

El objetivo del seminario fue abordar los retos de la aplicación de medidas convencionales y no convencionales en la gestión integral de riesgos y los desafíos que significan estos nuevos retos para los gestores de riesgos financieros en los bancos centrales.

### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

En el seminario se expusieron diferentes herramientas de riesgos financieros, como el sistema interno de calificación del Banco de España el cual podría ser aplicado a las necesidades del Departamento de Control de Inversiones. También se analizaron modelos de asignación estratégica de activos, con énfasis en la distribución de divisas en las carteras de inversión, lo cual es un tema de interés para el Departamento. Así mismo, se expusieron modelos de gestión de riesgo crediticio par el portafolio de reservas internacionales, los cuales se analizarán para ver su aplicación en el BCB.

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

El seminario permitió intercambiar criterios sobre la gestión integral de riesgos en los bancos centrales, además de conocer herramientas de análisis de riesgo financiero que se podrian aplicar al Departamento de Control de Inversiones.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y V°B° DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 VARINIA S. TINDAL FELIPEZ JEFE DEL DEPARTAMENTO DE CONTROL DE INVERSIONES BANCO CENTRAL DE BOLIVIA
--------------------------------	--

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha: 16 05 2019

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. ÁREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA/ ASESORIA :	ASESORÍA DE POLÍTICA ECONÓMICA
SUBGERENCIA :	INVESTIGACIONES ECONÓMICAS
DEPARTAMENTO :	INVESTIGACIONES EN BANCA CENTRAL

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	PAOLA CECILIA YUJRA TONCONI		
NOMBRE DEL EVENTO :	CURSO: "ANÁLISIS DE LAS POLITICAS MONETARIAS Y FISCALES CON MODELOS DSGE		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 06 / 05 / 2019	AL: 10 / 05 / 2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO: BOGOTÁ - COLOMBIA
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	9.940,14	COSTO DE PASAJES (Bs).	4.970,16

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

El objetivo del evento fue: Abordar el análisis, la elaboración, el uso y la interpretación de los modelos DSGE, brindando a los participantes una introducción a los modelos y técnicas utilizadas comúnmente por las autoridades responsables de la política económica para analizar cuestiones monetarias y fiscales.

### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

El evento bases del marco teórico, analítico y práctico para la elaboración de modelos cuantitativos bajo el enfoque de equilibrio general, metodología ampliamente adoptada por los bancos centrales de la región. El contenido permitirá complementar aspectos teóricos y prácticos del Modelo de Equilibrio General Dinámico Estocástico que se encuentra en desarrollo y evaluación en la Asesoría de Política Económica del BCB. Aspectos puntuales, como estimación bayesiana, cambios de régimen y la presencia de fricciones financieras darán lugar a generar ejercicios complementarios para el pronóstico, simulación y evaluación de la política monetaria.

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

La asistencia al evento permitió profundizar el marco analítico para la evaluación de la política monetaria bajo el contexto de equilibrio general, se abordaron temas de reciente desarrollo como la existencia de fricciones financieras, estimación bayesiana y cambios de régimen, que permiten realizar ejercicios con la finalidad de generar recomendaciones de política económica bajo un respaldo teórico y estructural. El evento fue de alto nivel en el que además se compartieron experiencias de modelación con los equipos técnicos de otros países.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y VºBº DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 DAVID E. ZEBALLOS CORIA JEFE DEL DEPTO. DE INVESTIGACIONES EN BANCA CENTRAL BANCO CENTRAL DE BOLIVIA VºBº INMEDIATO SUPERIOR
--------------------------------	--

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha:

24 05 2019

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. ÁREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA/ ASESORIA :	ASESORIA DE POLITICA ECONOMICA
SUBGERENCIA :	SUBGERENCIA DE INVESTIGACIONES ECONOMICAS
DEPARTAMENTO :	DEPARTAMENTO DE INVESTIGACIONES EN BANCA CENTRAL

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	HUGO PABLO ROCHA PORTUGAL		
NOMBRE DEL EVENTO :	MACROPRUDENTIAL AND FINANCIAL STABILITY MODELING		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 13/05/2019	AL: 17/05/2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO BRASILIA - BRASIL
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	2.485,04	COSTO DE PASAJES (Bs).	

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

Combinar ideas teóricas y conceptuales con sesiones prácticas sobre modelos semi-estructurales utilizando MATLAB e IRIS toolbox. Revisar building blocks de la política macroprudencial y orientados a la estabilidad financiera. Desarrollar modelos simples con base a este entorno teórico. Construir simulaciones y pruebas de stress.

### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

La asistencia de la analista al taller permitirá desarrollar sus capacidades para la formulación de modelos macroeconómicos que se constituyen en instrumentos de utilidad para el análisis de política monetaria y la elaboración de proyecciones macro, tareas realizadas por la APEC, poniendo énfasis en la importancia de la estabilidad financiera. Los conocimientos impartidos también serán de relevancia para llevar adelante tareas de investigación y análisis por parte del analista de referencia

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

El curso demostró que la mejor política macroprudencial activa que se puede tomar es la de crear colchones contracíclicos financieros incurriendo en un costo de crecimiento pero subsanando los problemas que la crisis y el riesgo agregado no diversificable pueden generar llegado cierto momento. El toolbox Iris en Matlab ayuda a reducir tiempos de estimación y cuando existe una buena identificación y calibración son importantes elementos para evaluar políticas.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y V°B° DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 DAVID E. ZEBALLOS-CORIA JEFE DEL DEPTO. DE INVESTIGACIONES EN BANCA CENTRAL V°B° INMEDIATO SUPERIOR BANCO CENTRAL DE BOLIVIA
--------------------------------	--

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

\_\_\_\_\_  
FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha:

5

06

2019

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. ÁREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA/ ASESORÍA :	GERENCIA GENERAL
SUBGERENCIA :	
DEPARTAMENTO :	

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	PEDRO SANCHEZ MONTOYA		
NOMBRE DEL EVENTO :	PASANTÍA EN PREVENCIÓN DE LEGITIMACIÓN DE GANANCIAS ILÍCITAS - BANREP		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 13 / 05 / 2019	AL: 17 / 05 / 2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO BANCO DE LA REPÚBLICA DE COLOMBIA
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	9.940,14	COSTO DE PASAJES (Bs).	4.970,97

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

Conocer la experiencia, políticas y procedimientos de otro banco central respecto a:

- a) Programas antilavado en banca central y la normativa nacional e internacional que la sustenta
- b) Métodos y medios para la investigación financiera de operaciones inusuales y sospechosas
- c) Debida diligencia a funcionarios internos de banco central y funcionarios PEP
- d) Áreas involucradas, procedimientos y controles internos que son alcanzados por la prevención de lavado
- e) Enfoque basado en riesgo para la identificación y administración de riesgos de lavado



### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

Conforme al conocimiento adquirido en la Pasantía, se realizará una Evaluación de Riesgo de Legitimación de Ganancias Ilícitas (LGI) para identificar nuevos procesos donde corresponda implementar controles, ampliando así los procedimientos de prevención de LGI en el Banco.

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

Se realizó la Pasantía cumpliendo con las actividades programadas; donde se conoció como realizan su proceso de prevención de LGI. Se recomienda para el BCB efectuar una Evaluación de Riesgo de LGI, donde se identifiquen nuevos procesos críticos de riesgo e implementar procedimientos de control, firmar convenios con instituciones públicas que provean información que ayude en la alimentación de base de datos para efectuar la debida diligencia y evaluar si corresponde la creación de un cargo adicional o área para la gestión de prevención de LGI.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y V°B° DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 <b>CARLOS A. CORDOVA LÓPEZ</b> <b>GERENTE GENERAL S.I.</b> <b>BANCO CENTRAL DE COLOMBIA</b>
---	--

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha:

7

6

2019

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. ÁREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA/ ASESORÍA :	OPERACIONES MONETARIAS
SUBGERENCIA :	OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO
DEPARTAMENTO :	

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	LUIS FERNANDO CERNADAS MIRANDA		
NOMBRE DEL EVENTO :	PASANTIA EN OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 15 / 05 /2019	AL: 17 / 05 /2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO LIMA - PERU
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	3,143,34	COSTO DE PASAJES (Bs).	7,100,10

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

El evento tuvo como objetivo conocer los instrumentos y mecanismos de regulación monetaria utilizados por el BCRP, los canales de transmisión que se tienen sobre niveles de liquidez en contextos de economías con diferentes grados de dolarización, adquirir conocimientos sobre los detalles operativos, informáticos y contables de la implementación de las Operaciones de Mercado Abierto (OMA).

La pasantía fue realizada diariamente de 09:00 am a 18:00 pm, dividiendo cada día en dos sesiones, fue guiada por los Subgerentes de área y por el Gerente de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera.

### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

Los instrumentos y mecanismos en implementación de Operaciones de Mercado Abierto son un tema importante en cualquier Banco Central del mundo, y Bolivia no es la excepción. En ese sentido, se debe considerar que en una economía bimonetaria los instrumentos de cobertura cambiaria son, casi, una necesidad para guiar al tipo de cambio hacia la senda deseada o en otros casos realinear las expectativas de tipo cambio. En esa línea, presento un documento inicial que explora la utilización de forwards como instrumento de estabilización cambiaria y que intenta, a su vez, minimizar la pérdida de reservas internacionales.

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

Es necesario continuar con el programa de capacitación mediante pasantías en otros Bancos Centrales a fin de conocer los instrumentos y mecanismos empleados por estos. Asimismo, se recomienda mayores estudios a fin de encontrar la mejor forma de implementar instrumentos financieros de cobertura cambiaria, que probablemente serán necesarios ante variaciones en las expectativas cambiarias de los agentes económicos.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y VºBº DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 ABEL F. SANJINES ALVAREZ GERENTE DE OPERACIONES MONETARIAS INMEDIATO SUPERIOR BANCO CENTRAL DE BOLIVIA
--------------------------------	--

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

 FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS
---



GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS

Form. 3310-004

Fecha:

25 06 2019

# RESULTADOS POR VIAJES OFICIALES

(PARA USO DE LAS DIFERENTES ÁREAS Y/O UNIDADES ORGÁNICAS DEL BCB)

No.

## 1. AREA A LA QUE PERTENECE EL SERVIDOR PÚBLICO

GERENCIA ASESORÍA :	ASESORIA DE POLITICA ECONOMICA
SUBGERENCIA :	SUBGERENCIA DEL SECTOR MONETARIO Y FISCAL
DEPARTAMENTO :	DEPARTAMENTO DEL SECTOR MONETARIO Y FISCAL

## 2. DATOS PERSONALES DEL SERVIDOR PÚBLICO

NOMBRES Y APELLIDOS :	MONICA PATRICIA SANABRIA ROCHA.		
NOMBRE DEL EVENTO :	ESTADÍSTICAS MONETARIAS Y FINANCIERAS: CURSO AVANZADO		
FECHAS DE REALIZACIÓN DEL EVENTO :	DEL: 27 / 05 / 2019	AL: 07 / 06 / 2019	LUGAR DE REALIZACIÓN DEL EVENTO Centro de Capacitación Brasilia, en la ciudad de Brasilia, Brasil
MONTO ASIGNADO DE VIATICOS (Bs)	2.544,20	COSTO DE PASAJES (Bs).	0

## 3. CARACTERÍSTICAS DEL EVENTO

### 3.1 OBJETIVO DEL EVENTO

El curso tiene el objetivo de mejorar la compilación de los formularios estandarizados relacionados a cuentas monetarias de las entidades que componen el sistema financiero para poder facilitar la comparabilidad entre países.

### 3.2 IMPACTO O BENEFICIOS PARA EL ÁREA Y EL BCB

Los conocimientos adquiridos en el curso permitieron entender con mayor profundidad aspectos generales sobre las estadísticas estandarizadas del Fondo Monetario Internacional, y servirán para mejorar la compilación de estadísticas monetarias que realiza el Departamento del Sector Monetario y Fiscal.

### 3.3 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

El contenido del curso abarcó la compilación de estadísticas monetarias en formularios estandarizados de varias entidades financieras. En este sentido, se recomienda la participación en otros cursos organizados por el departamento de estadística del FMI, además de la participación de todos los compiladores de estadísticas monetarias y financieras del Subgerencia del Sector Monetario y Fiscal (SMF) en este y en otros cursos similares.

## 4. FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO DEL BCB Y VºBº DE SU INMEDIATO SUPERIOR

 FIRMA DEL SERVIDOR PÚBLICO	 MARIA ANGELICA AGUILAR MARQUEZ JEFE DEL DEPARTAMENTO DEL SECTOR MONETARIO Y FISCAL e.i BANCO CENTRAL DE BOLIVIA
--------------------------------	---

## 5. FIRMAS AUTORIZADAS (PARA USO EXCLUSIVO DE LA GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS)

FIRMA Y SELLO DE RECEPCIÓN GERENCIA DE RECURSOS HUMANOS