



UVM
LAUREATE INTERNATIONAL UNIVERSITIES®

EDUCACIÓN
CONTINUA

DIPLOMADO
**ADMINISTRACIÓN
DEL RIESGO
FINANCIERO**

DIPLOMADO

PRESENCIAL 112 HORAS

ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO FINANCIERO

CONOCE MÁS

OBJETIVO

Proporcionar al participante los conocimientos teórico-prácticos más actualizados para la administración del riesgo y sus aplicaciones para la toma de decisiones estratégicas, la gestión de activos y pasivos, la asignación de capital, la evaluación del desempeño y el cumplimiento con las normas legales.

Adquirir una comprensión profunda de las interrelaciones que existen entre métodos de valuación, realización de coberturas, estrategias de inversión y análisis de riesgo.

Comprender las regulaciones pertinentes y efectuar los cálculos de riesgo necesarios para cumplir con ellas.

Al finalizar el diplomado, los alumnos estarán en condiciones de analizar, gestionar y operar los instrumentos financieros nacionales e internacionales para cubrir eficientemente el riesgo de una empresa y lograr rendimientos esperados con un nivel de riesgo razonable.



BENEFICIOS

- Los participantes habrán logrado incorporar los conocimientos, herramientas, técnicas y metodologías necesarias para el proceso de administración de los riesgos financieros. También conocerán las regulaciones existentes y sabrán como implementarlas.
- La estructura del diplomado tiene una secuencia adecuada que permite al participante ir adquiriendo el conocimiento de una forma paulatina e incremental, así como un proceso de aplicación y práctica que refuerza los aspectos conceptuales.
- Se utiliza el software financiero más adecuado para implementar cada parte específica.

A QUIEN VA DIRIGIDO

Directivos, gerentes, tesoreros, auditores, contralores, ejecutivos y analistas financieros que sean responsables de la administración de portafolios, de la administración del riesgo financiero, o del análisis crediticio. También a responsables de las tesorerías de empresas que desean tomar un papel activo en la administración de activos y pasivos.

CONOCE MÁS

Módulo 1

Regulación Local e Internacional sobre la Administración del Riesgo

- Antecedentes: Basilea I, recomendaciones de G-30.
- Basilea II, requerimientos de capital por tipos de riesgo.
- Basilea III, ¿qué se está proponiendo?
- Regulación de riesgos en México, la CUOEF.
- Regulación en México y prácticas de riesgo para Sofomes Reguladas, Sofomes no reguladas y Fundaciones de Beneficiencia Privada.

Módulo 2

Riesgo de Mercado

- Revisión de Mercados Financieros: bonos, acciones, dividendos.
- Introducción al riesgo: calificaciones, betas, indicadores de rendimiento ajustados por riesgo.
- El Valor en Riesgo (VaR).
- Métodos de cálculo del VaR, aplicaciones a portafolios de acciones.
- Nuevas tendencias: Fundamental Review of the Trading Book.

Módulo 3

Opciones

- Características de las Opciones Financieras.
- Métodos de valuación, la fórmula de Black-Scholes, los árboles binomiales.
- Las sensibilidades de las opciones: delta, gama, teta, vega.
- El VaR de portafolios de opciones.

CONOCE MÁS

Módulo 4

Riesgo de Tasas de Interés

- Bonos, valuación y sensibilidades, la duración.
- Los Swaps de tasas de interés.
- Coberturas de riesgo de tasas con Forwards y Swaps.
- El VaR de portafolios de renta fija.

Módulo 5

Fundamentos de Riesgo Crédito

- Descripción.
- Medición de parámetros: pérdida esperada, probabilidades de incumplimiento.
- Transiciones entre distintos niveles de clasificación del riesgo.
- Estimación de parámetros a partir de precios de acciones (Modelo de Merton).
- Nuevas tendencias: reservas por deterioro bajo IFRS 9.

Módulo 6

Estrategias de Riesgo Crédito

- El Credit VaR.
- El modelo aditivo (Modelo de Vasicek).
- Las correlaciones del incumplimiento.
- Requerimientos de capital por riesgo crédito.
- Nuevas tendencias: efecto de las bursatilizaciones de créditos.

CONOCE MÁS

Módulo 7

Riesgo Operativo

- Definición, distintas categorías.
- El capital de riesgo operativo requerido por la regulación bancaria.
- Frecuencia y severidad de las pérdidas.
- Métodos para obtener la información.

Módulo 8

Riesgo de Liquidez

- Características del Riesgo de Liquidez.
- El flujo de efectivo en riesgo.
- Nuevas tendencias: los indicadores de Basilea 3.

Módulo 9

Medición y Aplicaciones del Capital Ajustado por Riesgo

- Medición del capital ajustado por riesgo: métodos estándar y avanzados.
- Las distintas componentes del capital ajustado por riesgo y su combinación.
- Asignación de recursos en las empresas.
- Efectos de la diversificación.
- Nuevas tendencias: el rendimiento ajustado por riesgo (RAROC).

CONOCE MÁS



EDUCACIÓN
CONTINUA

universidaduvm.mx