

Certificación

Administración

Integral de Riesgos

MODALIDAD: PRESENCIAL

DURACIÓN: 96 HORAS

Si eres ...

- Directivo, gerente, tesorero, auditor, contralor, regulador o analista financiero y estás a cargo de la administración de portafolios, riesgos financieros o análisis crediticio, este diplomado es para ti.

Aprenderás ...

- A administrar de manera eficiente los peligros de una institución.
 - A identificar los riesgos a los que está expuesta la empresa en términos financieros
- A implementar soluciones para mitigar o eliminar los riesgos.
- Conceptos básicos sobre estadística, administración de activos y pasivos, y riesgos operativos.
- A generar mayor rentabilidad para la empresa a partir de estrategias en cuestión de riesgos financieros.
- Acerca de metodologías de Rentabilidad Ajustadas por Riesgos (RAPM por sus siglas en inglés)

Al concluir este programa...

- Tendrás los conocimientos necesarios y actualizados para la administración de riesgos y sus aplicaciones. Esto te ayudará en el proceso de toma de decisiones, ya que te enfocarás en variables que pueden beneficiar o perjudicar a otras áreas de la empresa, tales como; riesgos financieros, operativos, estratégicos y el cumplimiento de las normas legales y regulaciones.

MÓDULOS

01 Fundamentos de Administración de Riesgos

1. Matemáticas Financieras
2. Valuación de Bonos
3. Estadística Descriptiva: Media, varianza, covarianza, correlación, percentiles.
4. Distribución de probabilidad normal
5. Teoría de portafolios

02 Riesgo de Mercado

1. Introducción a los mercados financieros: Bonos, acciones, derivados y cambios
2. Valor en Riesgo (VaR)
3. Metodologías de Cálculo del VaR: Histórico, Delta-Normal
4. Duración y Convexidad
5. Riesgo en Portafolios de Acciones
6. Back Testing y Stress Testing
7. Uso de Derivados para la cobertura del Riesgo Mercado: Forwards, Futuros y Opciones
8. Riesgo de Contraparte (CVA)

03 Riesgo de Crédito

1. Definiciones para Riesgo Crédito: Severidad de la Pérdida, Probabilidad de Incumplimiento y Exposición al Incumplimiento
2. Tipos de Riesgo Crédito. Pérdida Esperada y no esperada
3. Modelos para Calcular la Probabilidad de Incumplimiento
4. Cálculo de la Severidad de Pérdida
5. Scoring
6. Modelos para calcular la Pérdida Esperada: Pricing y Modelos de precios basados en riesgos

MÓDULOS

04 Riesgo de Liquidez y ALM

1. Riesgo de liquidez
2. Mejores prácticas para la administración del riesgo de liquidez
3. Planes de Contingencia de liquidez
4. Administración de activos y pasivos
5. Gap de Reprecio
6. Gap de Duración
7. Gestión del Activo y el pasivo a través de cambios en políticas internas de fondeo y crédito

05 Riesgo Operativo y Reputacional

1. Riesgo operativo, legal, tecnológico y reputacional
2. Tipologías de Riesgos operativos de acuerdo a sus causas: Basilea y CUB
3. Identificación de Riesgos operativos: Cuestionario de Autoevaluación, incidentes
4. Mapas de Calor
5. Tipos de controles
6. Riesgo inherente y riesgo residual
7. Indicadores de Riesgo Clave (KRIs), Indicadores de Desempeño Clave (KPI) e Indicadores de Control Clave (KCI)
8. Pérdida esperada y no esperada
9. Riesgo reputacional

06 Riesgo Integral

1. Administración de Riesgos Empresariales (ERM)
2. Riesgos Estratégicos
3. Basilea y el Capital Regulatorio
4. COSO
5. Pirámide de la Administración de Riesgos Eficiente
6. Administración de Riesgos y gobierno corporativo
7. Asignación de capital (Capital Allocation)

EDUCACIÓN
CONTINUA
UVM

PREPÁRATE