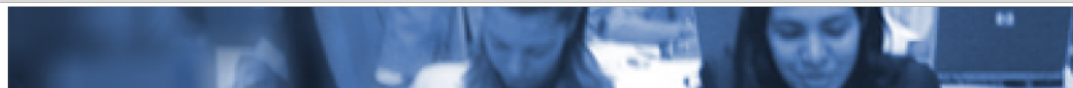




ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS FINANCIEROS



SCALAR CONSULTING CIA. LTDA.

A.S. CONSULTORES Y ASOCIADOS

IMPORTANCIA:

A partir de la conformación del **Comité de Basilea en Suiza**, con la participación de los principales bancos europeos hace más de 25 años y con la reciente consecución del documento final de Basilea II en **Junio del 2004**, se instauró una nueva ciencia que cuenta especialmente con el interés de las autoridades supervisoras de todo el mundo y que consiste en el **manejo adecuado y el control de los riesgos financieros**, dado que se había detectado su falencia como una de las principales causas de quiebra en las instituciones de intermediación.

Esta nueva ciencia es lo que hoy conocemos como la **Administración Integral de Riesgos Financieros**, la misma que cada vez toma mayor preponderancia en el ámbito bancario y microfinanciero, cuya aplicación es una necesidad primordial.

Dada su reciente aparición, alto nivel de requerimiento técnico y conocimientos en la parte **conceptual, legal y econométrico - práctico**, es que ponemos a su consideración el presente Diplomado, contando con el apoyo de la **Universidad Iberoamericana (UIA)**, una de las tres mejores universidades de México y conducido en la parte docente por **expertos reconocidos en el tema de riesgos a nivel internacional**.

DIRIGIDO A:

Gerentes Generales de Instituciones Financieras, Asesores, Financieros, Auditores, Jefes de Operaciones, Tesoreros y Analistas responsables de medir, supervisar, interpretar y reportar riesgos.

Personal de entidades financieras y universidades interesados en **conocer a profundidad los fundamentos conceptuales y prácticos de los riesgos financieros**.

OBJETIVOS GENERALES:

- Conocer paso a paso los **procesos de implementación** para la medición, control y prevención de los riesgos de mercado, liquidez, crédito y operativo, entre otros, así como la importancia de éstos en los resultados y su **impacto en el valor patrimonial** de las instituciones financieras en general;
- Desarrollar con detalle las **metodologías cuantitativas** actualmente utilizadas en la gestión de riesgos;
- **Generar e interpretar indicadores** que sirvan de base para realizar un eficiente mecanismo de control y seguimiento;
- Evaluar los **distintos modelos de riesgos** existentes en diferentes mercados, bajo diversos supuestos;
- Comprender los retos inherentes en la **administración integral de riesgos**.



ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS FINANCIEROS



SCALAR CONSULTING CIA. LTDA.

A.S. CONSULTORES Y ASOCIADOS

METODOLOGÍA:

El Diplomado de Especialización en “**Administración Integral de Riesgos Financieros**” es de naturaleza **eminentemente práctica** ya que cada uno de los conceptos estudiados se encuentra respaldado por **ejercicios realizados en talleres tanto individuales como en grupos de trabajo**,

Los participantes desarrollarán las metodologías y procedimientos desde el inicio, los mismos que podrán **poner en práctica en forma inmediata en sus actividades profesionales**.

El Diplomado contará en forma didáctica con las siguientes facilidades:

- Las clases serán impartidas **una vez por mes**, con asignación de trabajo extraescolar que permita **asimilar y reforzar de mejor manera los conocimientos adquiridos**, con la supervisión de los cate-dráticos expertos en el tema.
- **Desarrollo en forma amigable de los conceptos estadísticos y financieros indispensables en la gestión del riesgo**, para comprender para qué y cómo son utilizados en la práctica y, especialmente, **cómo interpretar los resultados derivados del análisis del riesgo**.
- **Estudio de casos prácticos** de distintos escenarios de riesgos tanto de liquidez, como de mercado, crédito y operativo.
- Análisis de back testing y stress testing, pruebas de correlación, asignación de cupos de crédito, imple-mentación de modelos scoring.
- **Análisis detallado de los Reglamentos de Riesgos de Mercado y Liquidez**, así como **estableci-miento de límites, alertas y métodos para realizar simulaciones** que permitan elaborar **planes de contingencia**, entre otros.

CARACTERÍSTICAS GENERALES:

El Diplomado consiste en **12 Módulos** secuenciales, con una carga horaria de **10 horas por Módulo**.

DURACIÓN TOTAL:

6 Meses



ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS FINANCIEROS

SCALAR CONSULTING CIA. LTDA.

A.S. CONSULTORES Y ASOCIADOS

MODALIDAD:

Presencial, **una vez al mes**, en los siguientes días y horarios propuestos

- Jueves 17:00-21:00 (4 horas).
- Viernes 09:00-17:00 (8 horas).
- Sábados 09:00-17:00 (8 horas)

Los módulos **se reforzarán con trabajo extraescolar** que los estudiantes podrán realizar **a su propio paso** y que permita asimilar y reforzar de mejor manera los conocimientos adquiridos, con la supervisión semipresencial de los **catedráticos expertos en el tema**.

PROGRAMA GENERAL:

MÓDULO 1: **INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS.**

MÓDULO 2: **HERRAMIENTAS INDISPENSABLES EN LA GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS.**

MÓDULO 3: **ESTUDIO DE CONCEPTOS Y METODOLOGÍAS COMPRENDIDOS EN BASILEA II.**

MÓDULO 4: **ANÁLISIS GAP Y RIESGO DE TASA DE INTERÉS Y LIQUIDEZ.**

MÓDULO 5: **RIESGO DE MERCADO: PRECIOS Y TIPO DE CAMBIO.**

MÓDULO 6: **APLICACIONES DE LA METODOLOGÍA DEL VALOR EN RIESGO (VAR) EN RIESGOS DE MERCADO Y LIQUIDEZ.**

MÓDULO 7: **RIESGO DE CRÉDITO: COMPARACIÓN DE METODOLOGÍAS DE BASILEA.**

MÓDULO 8: **RIESGO DE CRÉDITO: MODELOS AUXILIARES Y COMPLEMENTARIOS.**

MÓDULO 9: **RIESGO OPERATIVO: ENFOQUE CUALITATIVO Y POR PROCESOS.**

MÓDULO 10: **RIESGO OPERATIVO: MODELOS INTERNOS AVANZADOS.**

MÓDULO 11: **INTRODUCCIÓN AL MANEJO DE SERIES DE TIEMPO Y OTRAS METODOLOGÍAS CUANTITATIVAS.**

MÓDULO 12: **INSTRUMENTOS DERIVADOS Y OTRAS COBERTURAS DEL RIESGO.**



UNIVERSIDAD
IBEROAMERICANA
CIUDAD DE MÉXICO

Diplomado en:

ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS FINANCIEROS



SCALAR CONSULTING CIA. LTDA.

A.S. CONSULTORES Y ASOCIADOS

MATERIALES:

Los CD-Rom y material impreso serán entregados al inicio de cada módulo. Solicitamos que los participantes cuenten con una computadora portátil.

INICIO DEL DIPLOMADO :

El Diplomado de Especialización en “**Administración Integral de Riesgos Financieros**”, dará inicio el **12 de Enero del 2006**.

LUGAR:

Hotel **V CENTENARIO**, Santo Domingo, República Dominicana.