

2009



DIPLOMADO DE ESPECIALIZACIÓN EN RIESGO

www.riesgobancario.com



Objetivos

- Formar profesionales especialistas en gestión de riesgo financiero, que les permita evaluar y controlar la creación de valor en los diferentes negocios en los que operan.
- Contribuir a la creación en el país de la cultura de gestión del riesgo financiero en las entidades financieras y empresas del entorno dominicano.
- Facilitar a los participantes una sólida base teórico – práctica sobre el funcionamiento de la gestión de riesgo, enfocada desde la normativa nacional hasta modelos propios de evaluación.



Metodología

El Diplomado de Especialización en Gestión de Riesgos Financieros combina el análisis de elementos teóricos con el desarrollo de casos prácticos que le permitan al participante poner en funcionamiento los conceptos aprendidos sobre la realidad de la Institución Financiera para la que labora.

El trabajo de clase se verá reforzado con trabajos de investigación dirigida, individuales o colectivos, bajo la dirección de los docentes.

El Diplomado aprovechará la aplicación de estrategias metodológicas como:

- Método inductivo para mostrar las fórmulas a partir de casos particulares.
- Desarrollo de talleres.
- Solución de problemas prácticos con uso de tecnologías. Simulaciones desarrolladas en computador.
- Estudio de casos.



¿A quién va dirigido?

A Ejecutivos y Profesionales con responsabilidad en las áreas o divisiones de evaluación o gestión de riesgos, tesorería, planificación, auditoría de las instituciones bancarias y financieras que requieran de una fuerte orientación práctica y cognoscitiva en medición y evaluación de riesgos.





PROGRAMA



Módulo I (Elementos básicos de una adecuada gestión de riesgo financiero)

Este módulo describe y analiza las principales funciones de las Unidades de Riesgo dentro de la institución financiera: Como organizarlas a nivel funcional y operativo, sus principales funciones, cuales son los requerimientos planteados por el órgano regulador y como deberían aprovecharse.

Además se analizarán las normativas regulatorias a nivel internacional incluyendo el Segundo Acuerdo de Capitales (Basel II) sus implicaciones sobre el sector financiero dominicano

Duración: 5 sesiones.

Modulo II (La Estadística, y la Econometría en la gestión de Riesgo Financiero)

En este módulo se explorarán en conjunto con los estudiantes, los mecanismos estadísticos y econométricos más destacados en el análisis de riesgo financiero, incluyendo el desarrollo de casos que permitan interiorizar los conceptos teóricos discutidos.

Duración: 8 sesiones.

Módulo III (Riesgo de Mercado)

Este modulo tiene por objeto analizar detalladamente los mecanismos utilizados local e internacionalmente para medir y gestionar este tipo de riesgo, con la ayuda de casos prácticos se analizarán: El Valor en Riesgo, la Duración y sus diferentes modalidades, la Convexidad, el cálculo de la Aproximación de Taylor, el Riesgo de Tasas de Interés, Riesgo de Tipo de Cambio, la modelación de productos derivados, modelos de valoración de activos entre otros.

Duración: 6 sesiones.

Módulo IV (Nivel Avanzado de medición de Riesgo de Crédito)

El Riesgo de Crédito es posiblemente el riesgo más explorado y menos comprendido, existen una serie de metodologías que las instituciones financieras no aprovechan en el proceso de generación de valor, estos serán analizadas, discutidas y puestas en funcionamiento, bajo un ambiente de laboratorio, que le permitirá a los estudiantes conocer y aplicar dentro de sus propias instituciones esos análisis.

Mediante la ayuda de sistemas estadísticos y econométricos el estudiante conocerá como desarrollará una matriz de migración, como determinar las Perdidas Esperadas y las Perdidas no Esperadas, Simulaciones de carteras, entre otros.

Duración: 8 sesiones.

Módulo V (Nivel Avanzado de medición de Riesgo de Liquidez)

En este módulo se analizará la problemática de la gestión agregada del riesgo de balance, Mecanismos tradicionales de control, la importancia de la dinámica: Un nuevo enfoque de medición de riesgo de liquidez, mecanismos de Simulación de Montecarlo y la resolución de casos, todo considerando la estructura regulatorio nacional e internacional.

Duración: 6 sesiones.

Módulo VI (Nivel Avanzado de medición de Riesgo Operacional)

El último módulo no menos importante es el Riesgo Operacional en el cual se analizarán: Procesos, funciones y procedimientos. Mejoramiento continuo bajo esquema COSO, Metodología de análisis e integración institucional, Medición estadística de eventos relacionados a pérdidas provocadas por riesgo operacional entre otros.

Duración: 6 sesiones.



INSTRUCTORES

Lic. Cristian R. Arroyo López

Licenciado en economía y con estudios de postgrado en Mercado de Valores, es experto en el desarrollo de modelos macro y microeconómicos, con especial énfasis en análisis de riesgo país para mercados emergentes. Su amplia experiencia en puestos gerenciales de entidades públicas, le dan una sólida visión y comprensión de los complejos procesos internos de las entidades y sus subsecuentes riesgos operativos, lo que aunado con sus destrezas y conocimientos en indicadores y modelaciones, le han facilitado el desarrollo de metodologías cuantitativas y cualitativas para la evaluación interna, útiles para esquemas como el Balance Score Card y semejantes.

Sus conocimientos en estadística y finanzas, fortalecidos por sus años de trabajo como consultor y la capacitación internacional (España), lo perfilan como una fuente obligada de consulta y referencia en temas de análisis y cuantificación metodológica de los fenómenos relacionados con el Riesgo Financiero.

Todas las cualidades expuestas, se convierten en fuente de información veraz y clara, gracias a su experiencia como profesor universitario dentro y fuera de Costa Rica.



Msc. Mark Sandoval Ulloa

Economista experto en formulación y evaluación de proyectos especializado en economía gerencial y decisiones bursátiles. Posee experiencia de más de 10 años en la elaboración de indicadores y modelos de medición y evaluación de posiciones, entornos sociales y económicos, así como de análisis financiero y administrativo de organizaciones y proyectos.

Sus múltiples áreas de estudio, tales como informática, sociología, contabilidad, matemática, estadística, recursos humanos, administración y ciencias naturales, realizadas en EUA, Alemania, Costa Rica, México, Inglaterra y España, le proveen y con el a nuestros clientes de una extraordinaria base multidisciplinaria para el amplio análisis de las empresas, los proyectos, el entorno social, el marco macroeconómico, los efectos y referencias microeconómicas y las siempre complejas interrelaciones entre las variables, decisiones y efectos que atañen a las empresas en el mundo veloz y globalizado que enfrentan y las determinan. Entre sus estudios específicos sobre el área de riesgo y análisis financiero, aparte de sus estudios formales son destacables: Riesgos financieros y operaciones internacionales (ESIC); Economía Bancaria (Freixas); Banca, finanzas y seguros (COTME de Barcelona); Estadística para Administración y Economía (ASW); Matemática para Administración y Economía (STT).

Con ese background de conocimiento y experiencia ha incursionado directamente y de forma naturalmente en el estudio del análisis de riesgo financiero, cubriendo áreas tales como el riesgo de mercado, el riesgo de liquidez, riesgo legal, riesgo de entorno, riesgo operacional, riesgo de imagen, riesgo de mercado, riesgo de crédito.





Frequently Asked Questions (Preguntas frecuentes)

1. ¿Quién impartirá el Diplomado?

El Diplomado de Especialización en Riesgo es desarrollado por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra, bajo el auspicio de Evologica S.A. y con profesores de la firma Consultora ASM Risk Consultors.

2. ¿Quién es ASM Risk Consultors?

ASM Risk Consultors es una empresa Costarricense dedicada a brindar soluciones informáticas, consultorías y capacitaciones sobre riesgo en Latinoamérica.

3. ¿Quién es Evologica S.A.?

Evológica, S.A., es una empresa de tecnológica de la República Dominicana. Evológica, S.A. y ASM Risk Consultors traen en conjunto al mercado de República Dominicana la primera versión de este diplomado.

4. Son los profesores Nacionales

Los profesores del Diplomado son todos extranjeros con amplia experiencia en el desarrollo de proyectos de Riesgo.

5. ¿Qué sucede si no participo en uno de los módulos?

No es posible obtener el título que lo acredite como Especialista en Riesgo si no se aprueban todos los cursos.

Para más información:

Tel.: +1 (809) 922-8983 / +1 (809) 867-4207

Email: mmadera@evologica.com / info@riesgobancario.com

Web: www.riesgobancario.com/diplomadord