

Diplomado en Administración de Riesgos Corporativos y Empresariales

Coordinador académico: M.A. Alfredo Hernández

Objetivo general

Al finalizar el diplomado, los participantes tendrán la capacidad de:

- Crear valor mediante la aplicación de la gestión de riesgos para asegurar el logro de los objetivos estratégicos de las empresas y corporativos.
- Aplicar conocimientos prácticos y teóricos a la administración de riesgos de las organizaciones de la economía en general.
- Manejar la regulación nacional e internacional de la administración de riesgos.
- Implantar los marcos de referencia más conocidos de control interno, gestión de riesgos, seguridad de la información y continuidad de negocios.

¿A quién va dirigido?

Directores de corporativos, directores de administración (CEOs), directores financieros (CFOs), directores operativos (COOs), directores de tecnología de la información (CIOs), emprendedores, auditores internos y externos, responsables de la seguridad de la información y de la continuidad de negocio de las organizaciones de la economía en general, así como consultores y autoridades reguladoras.

Módulo I

INTRODUCCIÓN A LA ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS

Objetivos

- Conocer la administración integral de riesgos de la organización y su regulación fundamental, nacional e internacional.
- Identificar los principales marcos de la administración integral de riesgos en el sector real.

Temario

1. Marco regulatorio

- Introducción
- Administración empresarial de riesgos (ERM©): definición y evolución histórica
- Regulación nacional de riesgos

- Regulación internacional de riesgos
 - COSO© e ISO9001©
 - ISO22000© e ISO27000©
 - Tendencias
2. Marco conceptual de la administración integral de riesgos
 - La filosofía del riesgo
 - El apetito por el riesgo (la capacidad de riesgo elegida por la organización)
 - Plataforma, instrumentación e infraestructura
 - La triple línea de responsabilidades
 - Implantación de la gestión empresarial de riesgos
 - COSO©, ISO9001:2015© e ISO31000©
 3. Elementos de la evaluación de riesgos
 - Matrices de riesgos y controles
 - Bitácoras de controles
 - Mapas de calor

Módulo 2

RIESGO OPERATIVO

Objetivo

Evaluar el riesgo resultante de los principales factores de riesgo operativo: legales, tecnológicos, de proceso, humanos y de reputación.

Temario

1. Estructura de información y conceptos fundamentales para la evaluación del riesgo operativo
 - Identificación de riesgos operativos y análisis de causa raíz (RCA)
 - Base de datos de incidentes
 - Frecuencia e impactos por eventos de riesgo
 - Riesgo inherente y riesgo residual
 - Tratamiento del riesgo (MATE)
 - Modelo LDA (distribución de pérdidas agregadas)
 - Pérdida esperada y pérdida inesperada
2. Elementos básicos para el desarrollo de modelos internos
 - Modelo de gestión del riesgo operativo
 - Logro de los objetivos y perspectivas del balance score card ©
 - Indicadores clave: de desempeño (KPI), de riesgo (KRI) y de metas (KGI)
 - Calibración del modelo: backtesting y pruebas de estrés
3. Asignación de capital para enfrentar los riesgos
 - Antecedentes históricos
 - Capital básico y sus capas
 - Reservas y provisiones
 - Seguros

Módulo 3

ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS EN PROYECTOS ESTRATÉGICOS

Objetivo

Aprender los elementos básicos estratégicos y prácticos para la administración de riesgos en proyectos.

Temario

1. Conceptos básicos de proyectos
 - Taxonomía de proyectos
 - Planeación de un proyecto
 - Identificación de recursos
 - Diagrama de Gantt
2. Identificación de riesgos en proyectos
 - Evaluación inicial
 - Negociación inicial del proyecto
 - Generación de la matriz de riesgos
 - Inicio y monitoreo del proyecto
3. Asignación de recursos para ejecutar el proyecto enfrentando los riesgos
 - Evaluación de la criticidad del proyecto
 - Estimación de la incertidumbre por actividad y del proyecto
 - El diagrama de Gantt con riesgos
 - Determinación de la ruta crítica
 - Seguimiento: avance programado y avance real
 - Negociación de los tiempos de avance
4. Revelación de los riesgos fundamentales de los proyectos
 - Riesgos sistémicos, factor humano e innovación tecnológica
 - Entorno de la organización y cascada de metas
 - Consecución de los objetivos mediante KPI o KRI y KGI

Módulo 4

ADMINISTRACIÓN DE CRISIS, SEGURIDAD DE LA INFORMACIÓN, BUSINESS IMPACT ANALYSIS Y DISASTER RECOVERY PLAN

Objetivo

Conocer los principales elementos del manejo de situaciones críticas que afectan la seguridad de la información y la continuidad de negocio.

Temario

1. Fundamentos de la administración de crisis
 - Capacidad de adaptación ante un cambio
 - Conducción de equipos en situaciones disruptivas
 - Modelos de administración de crisis y su aplicación

- Teoría de la intervención: estrategias para la toma de decisiones según los procesos y los resultados esperados
 - Liderazgo en crisis: escucha activa, empoderamiento, habilitación para el cambio
2. Seguridad de la información
- Introducción al concepto de seguridad de la información: confidencialidad, integridad, disponibilidad y desempeño
 - ISO27000©: estrategias y controles
 - COBIT© e ITIL© como marcos de operación en la gestión de riesgos
 - Modelo de mejora continua de la información: fases, componentes, implantación y monitoreo
 - Seguridad física
 - Controles lógicos, físicos y administrativos
3. Business Impact Analysis (BIA©) y Disaster Recovery Plan (DRP©)
- Planes de contingencia
 - Respuesta a las emergencias y recuperación del negocio
 - Recuperación después de desastres
 - Recuperación tecnológica
 - Comunicación (árbol de llamadas y comité de crisis)
 - Sede alterna
 - Planificación de pruebas

Módulo 5

RIESGO Y CONTROL FINANCIERO

Objetivo

Conocer e identificar los modelos que se aplican al tratamiento del riesgo financiero.

Temario

1. Riesgo de mercado
- Conceptos de riesgo de mercado: estado de resultados, volatilidad
 - Riesgo
 - Rendimiento
 - Correlación y covarianza
 - Métodos para la estimación de la volatilidad
 - Históricos
 - Dinámicos (ARCH, GARCH, EWMA)
 - Implícitos
 - Valor en riesgo
 - Metodologías de cálculo
 - Desagregación y análisis del valor en riesgo (marginal, incremental y contribución al valor en riesgo)
 - Calibración del modelo para calcular el valor en riesgo (backtest y prueba de estrés)

2. Medidas de sensibilidad
 - Factores de riesgo: tipo de cambio, tasas de interés, inflación y materias primas
 - Duración e inmunización de los flujos
 - Análisis de duración por nodos
 - Análisis por comparadores
 - Estrategia activa y pasiva del análisis de brecha
3. Coberturas reales
 - Presupuesto de riesgo-rendimiento
 - Pruebas de estrés y análisis de escenarios
 - Optimización y análisis del desempeño
4. Casos prácticos y riesgo contraparte
 - El perfil de riesgo
 - Las calificadoras y la fijación de precios
 - Vitro y Cemex
5. Riesgo de liquidez
 - Contexto y principios de gestión del riesgo de liquidez
 - Medidas para la gestión de la liquidez
 - Regulación
 - Pruebas de estrés
 - Planes de contingencia
 - Gestión del riesgo de liquidez dentro de la entidad
 - Gestión de activos y pasivos (ALM)

Módulo 6

MITIGANTES FINANCIEROS DEL RIESGO OPERATIVO EN LA ORGANIZACIÓN

Objetivo

Conocer y manejar las alternativas para gestionar, transferir y cubrir el riesgo operativo y financiero de la organización.

Temario

1. Derivados
 - Futuros
 - Swaps
 - Opciones
 - Estrategias
 - Cobertura
 - Mercados con tendencia al alza y a la baja
 - Mercados con alta volatilidad y baja volatilidad
 - Notas estructuradas
2. Seguros
 - Frecuencia e impacto
 - Gestión del riesgo usando seguros

- Seguros de responsabilidad civil
- 3. Opciones reales y bursatilizaciones
 - Manejo de opciones reales
 - Eficacia de las coberturas
 - Análisis de cartera para instrumentar una bursatilización
 - Tratamiento de las posiciones de bursatilización
 - Obligación colateralizada por deuda (CMO), tranches y duraciones

Talleres

Durante el diplomado se imparten talleres elementales para dar a los participantes una base homogénea de conocimientos y para que apliquen herramientas de gran utilidad para la práctica del administrador de riesgos.

1. Matemáticas Básicas y Estadística

- Construcción de Índices
- Estadísticas descriptivas
- Funciones de probabilidad
- Pruebas de asociación: correlación y tablas de contingencia
- Regresión Múltiple

2. Matemáticas Financieras

- Interés simple e interés compuesto
- Valor presente y valor futuro
- Valuación básica de instrumentos de inversión
- Ruta crítica
- Prácticas estratégicas
- Informes dinámicos
- Contienda de pronósticos
- Regresión múltiple

3. Modelos Analíticos para la Toma de Decisiones

- Dashboards y tableros de control
- Árboles de decisión
- Duración Probabilística de los Proyectos
- Modelos óptimos
 - Frontera de Pareto
 - Métricas de clasificación
 - Portafolios eficientes
 - Mapas de calor

Coordinador Académico

M.A. Alfredo Hernández

Ejecutivo Senior con 30 años de experiencia en el medio financiero y conocimiento en Administración Integral de Riesgos (de Crédito, Financieros y Operativos), Valuación de Instrumentos de Inversión, Supervisión de Unidades de Valuación, investigación estadística y financiera, así como supervisión y regulación de instituciones financieras. Con una fuerte orientación al logro de resultados, habilidades analíticas e implementación de sistemas y de equipos altamente eficientes, así como ética y responsabilidad probas en el trabajo.

De 2019 a la fecha, Subdirector de Administración Integral de Riesgos del PensionISSSTE. 2013 a 2018, Gerente de Riesgo Operativo en la Dirección de Control Interno en PROCESAR. 2012 a 2013, Consultor Financiero Independiente, FINAE S.A.P.I. de C.V. S.O.F.O.M. E.N.R. Crédito y Cobranza. Quantit, S.A. de C.V. Valuación Independiente, Administración de Riesgos y Auditorías Especializadas. 2010 a 2012, Proveedor Integral de Precios LATAM, S.A. de C.V. Director de Investigación y Desarrollo. 2004 a 2010, Técnica Administrativa Bal S.A. Subdirector de Riesgo de Crédito, Administrador de riesgo de crédito de las inversiones de Grupo Bal. 2004 a 2006, Afore Profuturo GNP, S.A. de C.V. Unidad de Administración Integral de Riesgos, Subdirector de Riesgos, Administración Integral de Riesgos de las Siefores. 2002 a 2004, Sociedad Hipotecaria Federal, S.N.C. Planeación y Control de Crédito, Subdirector de Supervisión y Metodologías de Valuación. Administración Integral de Riesgos, Especialista de Riesgo Crediticio. 1995 a 2002, Comisión Nacional Bancaria y de Valores, Metodologías de Supervisión, Supervisor en Jefe de Metodologías de Riesgo Crediticio y Director de Supervisión de Instituciones Financieras. 1992 a 1995, Grupo Financiero Invermexico, Subdirector de Portafolios de Instrumentos de Deuda / Análisis. 1990 a 1992, Banco Internacional, S.N.C., Subdirector de Desarrollo y Diseño de Metodologías. 1988 a 1990, Operadora de Bolsa Serfin, S.A. Gerente de Análisis del Mercado Accionario. Instituto Tecnológico Autónomo de México, diseño y coordinación de los programas de Diplomado de Administración de Riesgos para Instituciones Financieras y de Administración de Riesgos para Corporativos y Empresas. Escuela Bancaria y Comercial, elaboración del material del curso de Derivados para licenciaturas. Universidad Panamericana, Curso de Economía y Entorno Social para Diplomado de Capacitación Interna Deloitte. Proveedor Integral de Precios S.A. de C.V., Curso de Riesgo de Crédito.

Formación Académica:

Doctorate in Business and Administration, University of Liverpool, (en curso)	2012
Programa Integral de Desarrollo de Ejecutivos, ITAM, Ciudad de México	2006
Diplomado de Operación de Derivados, ITAM, Ciudad de México	2004
Diplomado en Modelos Económicos Dinámicos,	

ITAM, Ciudad de México	2003
Maestría en Administración de Empresas, ITAM, Ciudad de México	1997
Diploma en Estadística, University of Kent, Canterbury, Inglaterra	1988
Licenciatura en Matemáticas Aplicadas, ITAM, Ciudad de México	1984

INFORMES: Lunes a viernes de 8:00 a 20:00 h. Tel. 5628 4185, sin costo desde el interior: 01800 398 4826

Av. Camino a Santa Teresa 930, Col. Héroes de Padierna, 10700, México, D.F.

Programación y precios sujetos a cambios sin previo aviso.

El ITAM se reserva el derecho de posponer o cancelar los programas que no cumplan con el quórum mínimo requerido.

Consulte nuestra programación en:

www.desarrolloejecutivo.itam.mx