

Diplomado en Administración de Riesgos Corporativos y Empresariales (Versión en línea)

Coordinador académico: Alfredo Hernández

Nota: Este diplomado se imparte en línea con la herramienta Zoom. Se requiere que el participante cuente con computadora, laptop, tablet, teléfono inteligente o cualquier otro dispositivo que reproduzca audio y video, y una buena conexión a internet. Las clases serán en tiempo real en los días y horarios publicados. Las sesiones no serán grabadas y el participante solo tendrá acceso en el grupo al que se haya inscrito.

El diplomado comienza con tres módulos que comparte con otros diplomados de administración de riesgos, lo cual abre la oportunidad para que, con la obtención de este diplomado, se pueda realizar cualquiera de los otros en la mitad del tiempo.

Objetivo general

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

- Crear valor mediante la aplicación de la gestión de riesgos para alcanzar los objetivos estratégicos de las empresas y los 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, directores financieros, directores operativos, directores de tecnología de la información, 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

Administración integral de riesgos, matemáticas financieras y valuación

Objetivos

- Conocer el origen y las herramientas esenciales para la administración integral de riesgos.
- Identificar y analizar el impacto cualitativo del entorno económico, financiero y sectorial, su evolución y tendencias que afectan las principales variables externas, así como los atributos internos de la compañía para competir en su ámbito de operación.

Temario

1. Administración integral de riesgos
 - El modelo POCCM
 - Plataforma, instrumentación e infraestructura
 - Proceso de crédito: originación, administración y recuperación
 - Aplicación de un marco de gestión de riesgos empresariales: COSO, ISO9000:2015 e ISO31000
2. Matemáticas financieras
 - Valor del dinero en el tiempo
 - Tipos y tasas de interés.
 - Anualidades y perpetuidades
 - Tablas de amortización
 - Valuación de bonos
 - Valuación de acciones

Módulo 2

Marco conceptual de la administración integral de riesgos

Objetivos

- Aprender los conceptos fundamentales de la administración integral de riesgos, su taxonomía e identificación.
- Comprender la gestión de riesgos, habilitar y evaluar el ambiente de control, así como el tratamiento y la cobertura de los riesgos.

Temario

- Marco conceptual de la gestión de riesgos
- Procesos de la gestión de riesgos
- Diseño y evaluación de controles y del sistema de gestión de controles
- Formación de capital para cobertura de exposición al riesgo

Módulo 3

Conceptos avanzados en la gestión de riesgos

Objetivo

Conocer y comprender diversos temas de administración de riesgos y su aplicación en las instituciones financieras y en las organizaciones y empresas del sector real.

Temario

- Curva de Bradley Dupont
- Pensamiento basado en riesgos
- Modelo de las tres líneas de defensa. Actualización y evolución
- Control interno y el enfoque COSO
- Administración de riesgos en proyectos
- Funcionamiento teórico de los instrumentos financieros
- Derivados: funcionamiento y modalidades de operación

Módulo 4

Riesgos no discrecionales

Objetivo

Entender cómo los factores no discrecionales de las empresas afectan la gestión de sus riesgos y la consecución de sus objetivos institucionales.

Temario

1. Riesgo operativo
 - Principios básicos de la gestión del riesgo operativo
 - Modelo de gestión del riesgo operativo
 - Evaluación de riesgos y controles
 - Matrices de calor: frecuencia y tipos de pérdida
 - Riesgo operativo y enfoque regulatorio (Basilea y solvencia)
2. Riesgo estratégico
 - Objetivos de la identificación de riesgos estratégicos
 - Universo y taxonomía de los riesgos estratégicos
 - Enfoque metodológico
3. Riesgo reputacional: medición y gestión
4. Riesgo tecnológico
 - Seguridad de la información
 - Identificación de amenazas
 - Identificación de vulnerabilidades
 - Dimensiones de la seguridad de la información

- Cultura de la seguridad de la información
 - Ciberdefensa en la organización
 - ISO / IEC 27005: Nuevos estándares en la seguridad de la información
5. Riesgo legal
- Principios del riesgo legal
 - Gestión del riesgo legal

Módulo 5

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 los proyectos
 - Taxonomía de los proyectos
 - Planeación de un proyecto
 - Identificación de recursos
 - Diagrama de Gantt
2. Identificación de riesgos en los 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 del grado crítico del proyecto
 - Estimación de la incertidumbre por actividad y del proyecto
 - 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 indicadores claves de desempeño, riesgos y metas

Módulo 6

Crisis, seguridad de la información, análisis del impacto en el negocio y plan de recuperación de desastres

Objetivo

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

Temario

1. Manejo y gestión 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
 - COBIT® e ITIL® como marcos de operación en la gestión de riesgos
 - ISO27000®: estrategias y controles
 - Modelo de mejora continua de la información: fases, componentes, implantación y monitoreo
 - Controles lógicos, físicos y administrativos
 - Seguridad en la nube
 - Ruta hacia un entorno seguro

3. Análisis del impacto en el negocio y plan de recuperación de desastres
 - 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
 - Soluciones de continuidad de negocio en la nube

Talleres

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

1. Estadística para riesgos

- Construcción de índices
- Estadísticas descriptivas
- Funciones de probabilidad
- Pruebas de asociación: correlación y tablas de contingencia
- Regresión múltiple
- Simulación y convolución

2. Modelos analíticos para la toma de decisiones

- Cuadros de mando y tableros de control
- Árboles de decisión
- Duración probabilística de los proyectos
- Modelos óptimos
 - Frontera de Pareto
 - Mapas de calor

Coordinador Académico

M.A. Alfredo Hernández

Alfredo Hernández es un experto en análisis financiero con 25 años de experiencia y conocimientos en evaluación de riesgo de crédito de portafolios, de prospectos de inversión, operativos y de contrapartes de operación; investigación cuantitativa y cualitativa, así como supervisión bancaria y de unidades de valuación. Tiene una amplia perspectiva del sector financiero y su marco regulatorio, gracias a su trayectoria profesional en diversas instituciones como PiPLatam, Grupo Bal, Profuturo, SHF, CNBV, Banco Mexicano, Procesar y PensionISSSTE, asimismo ha dado diversas asesorías y consultorías a instituciones financieras de prestigio como el INFONAVIT y actualmente funge como subdirector de Riesgos en FIFOMI. Estudió la licenciatura en Matemáticas Aplicadas, el Diplomado en Modelos Económicos Dinámicos y la Maestría en Administración en el ITAM. Así mismo, cuenta con estudios preuniversitarios en Hallingdal y Fredtun Folkehoyskolen en Noruega; un curso en Investigación por Encuestas en la Universidad de Michigan, en los Estados Unidos; un Diploma en Estadística en la Universidad de Kent y una Maestría en Investigación en Administración y Negocios de la Universidad de Liverpool en Inglaterra. Es doctorante en Internacionalización de la Educación Superior, por parte del Centro de Estudios e Investigaciones para el Desarrollo Docente y ha sido catedrático del COLMEX, INSP, UNAM, ITAM, Universidad

Iberoamericana, IMERVAL, PIP Capacitación, Universidad Panamericana y con Global Alumni como Profesor Asistente en la Universidad de Chicago, así mismo colabora con el ITAM en la Coordinación de Diplomados de Administración de Riesgos.

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