



Diplomado en **Administración de Riesgos**

Inicia en Marzo 2025



IADA
INSTITUTO DE ALTA DIRECCIÓN
ANÁHUAC BUSINESS SCHOOL



Introducción

La Administración de Riesgos ha evolucionado drásticamente en los últimos 30 años, moldeada por crisis financieras, colapsos de grandes instituciones y avances tecnológicos que han transformado la manera en que gestionamos el riesgo. Desde la quiebra de Barings Bank en 1995 por fraude operativo hasta la crisis de Long-Term Capital Management en 1998, el sector financiero ha aprendido a fortalecer sus sistemas de control y regulación para mitigar impactos catastróficos. Con la crisis de 2008, desencadenada por el mal manejo de derivados de crédito, se implementaron nuevas regulaciones como Basilea III y Dodd-Frank, obligando a las instituciones a mejorar su gestión de riesgo de crédito, mercado y liquidez.

En los últimos años, los eventos de riesgo han sido aún más disruptivos: la pandemia de 2020 hizo volar las correlaciones, afectando modelos tradicionales y obligando a rediseñar metodologías de administración de riesgos. Los eventos climáticos recientes, como los huracanes que devastaron Acapulco y los incendios en Los Ángeles, han reconfigurado la forma en que las aseguradoras calculan primas y evalúan riesgos.

El nuevo Risk Manager ya no es solo un analista de métricas; ahora debe contar con habilidades técnicas avanzadas, dominio de tecnología, regulación, gestión estratégica y de comunicación que pueda advertir de cualquier suceso que ponga en riesgo a las instituciones. Las micro, pequeñas y medianas empresas (MiPyMEs), bancos, fondos de pensiones, aseguradoras y grandes corporaciones requieren equipos de administración de riesgos con capacidades técnicas, regulatorias y de management que puedan reportar adecuadamente a los consejos y comités de administración y asegurar la estabilidad financiera de sus organizaciones.

En este contexto, la digitalización ha revolucionado la gestión del riesgo. La inteligencia artificial (IA), Machine Learning y Big Data han redefinido el modelaje financiero y permiten anticipar escenarios con mayor precisión. Las empresas deben adaptarse a esta nueva era, incorporando comités de riesgo efectivos, con perfiles multidisciplinarios que integren tecnología, regulación y estrategia financiera.

Este diplomado te brindará el conocimiento y las herramientas necesarias para convertirte en un líder en administración de riesgos integral; capaz de proteger y asegurar el futuro financiero, operativo y estructural de cualquier organización.

Objetivo

Capacitar a los participantes en la administración integral de riesgos financieros, combinando principios técnicos, regulatorios y de management para diseñar estrategias que protejan el flujo de las empresas y fortalezcan su estabilidad. Se abordará la evolución de la administración de riesgos, los cambios en modelaje financiero y la incorporación de tecnología avanzada para la mitigación de riesgos en todos los sectores.

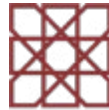
¿Quiénes lo deben cursar?

- **SOFOMES y Bancos:** Implementando estrategias de cobertura y gestión de riesgo de crédito.
- **Afores y Fondos de Pensiones:** Para optimizar estrategias de inversión y gestionar riesgos de mercado y liquidez para proteger el dinero de los ahorradores
- **Aseguradoras y Reaseguradoras:** Enfrentando los retos del cambio climático y modelaje de primas.
- **Casas de Bolsa y Hedge Funds:** Mitigando riesgos de mercado con herramientas cuantitativas avanzadas.
- **Grandes Corporativos y Tesorerías:** Implementando estrategias efectivas de administración de riesgos y reporte a Consejos de Administración.
- **Reguladores y Compliance Officers:** Fortaleciendo la supervisión y regulación de mercados financieros.

Este Programa otorga



40 Continuing Professional Development (CPD) credits GARP



COLEGIO NACIONAL DE ACTUARIOS, A.C.

El Colegio Nacional de Actuarios A.C., autoriza que el “**Diplomado en Productos Derivados**” que imparte RiskMathics, forme parte de las horas de educación continua para los actuarios certificados. Dicho curso otorgará un total de **33 HECSE** de las cuales 0 serán de normatividad.

Highlights del Programa

- **Crisis y sus lecciones:** Crisis del 2008, pandemia 2020, eventos climáticos y su impacto en la administración de riesgos.
- **Transformación del Risk Manager:** De medidor de riesgos (Matemáticos puros) a estrategia financiero y regulador. Management para llevar comités, UAIRs, Informar a los consejos de administración.
- **Tecnología aplicada al riesgo:** IA, Machine Learning, Big Data y su impacto en el modelaje financiero.
- **Comités de riesgo efectivos:** Cómo estructurarlos y reportar eficientemente a los Consejos de Administración.
- **Administración de Riesgos en diferentes industrias:** Afores, Bancos, Aseguradoras, Casas de Bolsa, Hedge Funds y Empresas.
- **Estrategias de cobertura en tiempos de incertidumbre:** Devaluación, volatilidad del mercado y protección de flujos financieros.
- **Riesgo Climático y su impacto en la industria aseguradora:** El futuro del cálculo de primas y la modelación de eventos extremos.



Faculty



ANTONIO CASTAÑO

Director de Tesorería

CIBANCO

Antonio Castaño cuenta con una amplia experiencia en mercados financieros y banca de inversión, tanto en México como en el extranjero. Actualmente, Antonio es el Director de Tesorería de CIBanco. Anteriormente, ocupó diversas posiciones en BBVA México, entre las que destacan haber sido el responsable de FX y de Credit Markets. Previo a unirse a BBVA, Antonio fue el DGA Financiero de Nacional Financiera, supervisando todas las actividades de inversión y Financiamiento. Adicionalmente, ha ocupado diversos cargos en UBS, la Secretaría de Hacienda y Crédito Público, Valores Finamex y Operadora de Bolsa. Ha sido miembro del consejo de Operadora de Fondos Nafinsa, MacMa, Médica Sur y el Fondo México, entre otros. Antonio es egresado de la Licenciatura en Actuaría (mención honorífica) del Instituto Tecnológico Autónomo de México (ITAM) y cuenta con una maestría en Administración de Empresas (MBA) por la Universidad de Stanford. Ha impartido cátedra en el ITAM, la Universidad Anáhuac y la UNAM.



ANDRÉS CORONA

CRO

Monte de Piedad

Andrés Corona es pionero en la implementación de Metodologías y Modelos de Administración Integral de Riesgos, tanto en México como en varios países de LATAM. Durante 23 años trabajó, entre otros, como Director de Administración Integral de Riesgos y Control Interno de Riesgos en BBVA Bancomer y Grupo BBVA, en donde logró la certificación de algunos de estos modelos internos como Modelos IRB, cumpliendo con el estándar de Basilea III, para creación de Reservas de Crédito y la asignación de Capital, ante la CNBV y Banco de España.



Faculty



MARIANA GARZA

Directora Intermediarios
& Family Offices

IT México

Mariana Garza es Directora de Intermediarios & Family Offices en IT México. Anteriormente fue Co-Head en el segmento Intermediarios & Family Offices en Compass México. Tiene más de 19 años de experiencia en el medio financiero en el área de Desarrollo de Productos y Ventas. Anteriormente, trabajó en Lorant MMS como Asociado de Ventas para Corporativos, en Estrategias de CI Banco como Director en Desarrollo de Producto y de Negocios y en Mexder como bróker de derivados. La mayor parte de su experiencia en el medio financiero fue en BlackRock, en el equipo de Ventas en el Segmento Intermediarios y Family Offices en México. Mariana es Licenciada en Relaciones Internacionales por la Universidad Iberoamericana.



GIOVANNI NEGRETE

Director, xVA Desk

Banco Santander

Giovanni Negrete actualmente es responsable de la mesa de xVA (CVA, DVA y LVA) en Banco Santander México, anteriormente estuvo en la misma mesa en Santander Global con sede en Madrid.

Previo a Santander, fue Senior Trader de los libros de Trading de Opciones Exóticas en Banesto. Giovanni es Doctor en Estadística Aplicada a la Economía por la UNED de España, Maestro en Finanzas Cuantitativas por la Escuela de Analistas Financieros Internacionales (AFI), y Maestro en Análisis Económico y Economía Financiera por la Universidad Complutense de Madrid.



JOSÉ MARÍA DE LA TORRE

Independent Financial
Professional

El Ing. José María de la Torre Vereá nació en la Ciudad de México el 20 de febrero de 1969. Realizó sus estudios universitarios en el Instituto Tecnológico de Monterrey donde obtuvo el título de Ingeniero Industrial y de Sistemas. Continúo su educación en el Massachusetts Institute of Technology (MIT) donde consiguió el título de Maestro en Administración de Empresas con concentración en Ingeniería Financiera. Posteriormente recibió el título de Maestro en Artes de la Yale University por completar satisfactoriamente los estudios de la Maestría en Economía Internacional y para el Desarrollo.

Comenzó su carrera profesional en Wall Street trabajando para el banco norteamericano J.



Faculty

P. Morgan en donde alcanzó el puesto de Vicepresidente de Estrategia de Mercados. A su regreso a México comenzó a laborar para la firma holandesa ING Asset Management; en esa empresa fue el responsable de la administración de los fondos de renta fija.

Posteriormente fue contratado por BBVA Bancomer en donde se desempeñó hasta 2012. En esa institución ocupó dos puestos relevantes: (1) Director de Estrategia de Mercados para América Latina; y (2) Director de Promoción de Productos Estructurados con Derivados de Acciones e Inversiones Alternativas. En esta última posición participó activamente en las colocaciones de Certificados de Capital de Desarrollo (CECADE) y de Fideicomisos de Inversión en Bienes Raíces (FIBRA). Entre 2012 y 2013, el Ing. de la Torre laboró como Consejero en Inversiones Patrimoniales para la institución norteamericana Citi Private Bank.

Por designación del Director General del ISSSTE y el Secretario de Hacienda y Crédito Público, el Ing. de la Torre consumó uno de sus logros profesionales más relevantes: ejercer un cargo en el Servicio Público. Estuvo a cargo del Fondo Nacional de Pensiones de los Trabajadores al Servicio del Estado. Sus logros principales como Vocal Ejecutivo de PENSIONISSSTE son los siguientes: (1) ubicar a tres de las cuatro SIEFORE en primero, segundo o tercer lugar de acuerdo con el Índice de Rendimiento Neto de la CONSAR durante más del 90% de su gestión; (2) aumentar los activos administrados de 105 mil millones de pesos a 170 mil millones de pesos; y (3) desarrollar una fuerza comercial que invirtió la tendencia de los traspasos (desde 16 mil millones de pesos en contra hasta 4 mil millones de pesos a favor).

El Ing. de la Torre concluyó su labor como servidor público en abril del 2017 y se incorporó a Planigrupo LATAM – uno de los consorcios más importantes de América Latina en la industria de los bienes raíces. Durante los nueve meses que prestó sus servicios ocupó el cargo de Asesor del Director General. En este rol, el Ing. de la Torre estuvo a cargo de la recompra de los Certificados de Capital de Desarrollo emitidos por esa sociedad en 2012 y además dirigió la oferta pública de acciones en México y diversos mercados internacionales.

Durante la primera mitad del 2019, el Ing. de la Torre laboró en Casa de Bolsa Bursamétrica como Director de Ventas a Clientes Institucionales. Esta institución es una boutique dedicada al financiamiento de proyectos de infraestructura.

El Ing. de la Torre trabajó en Grupo Financiero BANORTE como Director de Analítica.



Faculty



ARTURO ÁVILA

Responsable de Riesgo Operacional, Legal, Tecnológico y Continuidad de Negocio

Arturo Ávila Sánchez posee una trayectoria de cuarenta y dos años en el sector financiero, con dos décadas de experiencia en roles directivos. Su desarrollo profesional ha sido a través de una variedad de puestos dentro de la iniciativa privada y el sector público financiero. A lo largo de su carrera, ha liderado el desarrollo e implementación de diversos proyectos en diferentes áreas, abarcando campos como Administración de Riesgos, Planeación Financiera, Banca Corporativa, Banca Empresarial, Banca Comercial, Planeación Estratégica, Cartera, Operaciones y Recursos Humanos, siempre fundamentados en un sólido marco jurídico. En la actualidad, asume la responsabilidad de la implementación de la Gestión de Riesgo Operacional, Tecnológico y Legal, y lidera el desarrollo y puesta en marcha del Plan de Continuidad del Negocio (BCP). Como resultado de este esfuerzo obtuvo la autorización de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV) para la utilización del Método de Estándar Alternativo (MEA) en la determinación del componente de capitalización asociado al riesgo operacional de la institución, logrando mejorar significativamente el nivel de capitalización de la organización.

Los logros académicos de Arturo incluye Maestría en Finanzas Corporativas de la Facultad de Contaduría y Administración por la Universidad Nacional Autónoma de México (UNAM), Maestría en Seguridad de tecnología de la Información, así como la Licenciatura en Administración de Empresas y una Especialidad en Finanzas en la Universidad Tecnológica de México. Además, ha completado varios programas de especialización, entre ellos los diplomados en Fintech y Disrupción Financiera del Instituto Tecnológico Autónomo de México, así como, Riesgo de Crédito, Riesgos Integrales, Administración de Proyectos, Promotor de Valores y Dirección Estratégica Empresarial en el TEC de Monterrey. Actualmente, se encuentra estudiando el Doctorado en Administración de Negocios en la Universidad La Salle. Con su experiencia y sólida formación, Arturo se erige como un profesional con profundos conocimientos y habilidades en el campo financiero, contribuyendo de manera significativa al crecimiento y desarrollo del sector como de las organizaciones en las que ha participado.



Faculty

Licenciado en Derecho, con estudios de Posgrado en Administración y participación en programas de Desarrollo Directivo en el Instituto Panamericano de Dirección de Empresas (IPADE) y en el Instituto de Educación Superior de Empresa en España (IESE), así como Diplomado en Riesgo por el Instituto Tecnológico de Monterrey (ITESM). 25 años de experiencia en el ramo de las Tarjetas de Crédito y Créditos al Consumo desde el otorgamiento hasta su Cobranza y Recuperación, pasando por la Planeación Estratégica, Administración de Proyectos y Tecnología, así como la Gestión Comercial de estos portafolios y la Prevención de Fraudes.

Se ha desempeñado dentro del área de Riesgos en la Prevención de Fraudes en tarjetas así como otros canales y medios de pago, primero en BBVA Bancomer, luego en HSBC, y ahora en Citibanamex desde diciembre de 2015.

Ha sido miembro de Comités Latinoamericanos e Internacionales de Prevención de Fraudes en Visa y MasterCard y ha coordinado también el grupo de Prevención de Fraudes de la Asociación de Bancos de México (ABM). Recibió el reconocimiento a la “Excelencia en el Control y Prevención de Fraudes” por parte de Visa en el “Security Summit” en México.

Ha participado como presentador en diversos foros: En Estados Unidos, invitado por The Economist y Visa en el Global Security Summit en Washington, así como en San Francisco, también Estados Unidos y en Madrid, España, invitado por Fair Isaac Corporation, en la Asociación Bancaria en Colombia, así como en Sao Paulo en Brasil, Costa Rica, República Dominicana y México invitado por diferentes Compañías. Ha participado en programas de “Mentoring” y contribuido compartiendo experiencias sobre liderazgo en diferentes áreas en los bancos en que ha trabajado.

Ha tenido experiencia en áreas Corporativas de Recursos Humanos, ventas y mercadotecnia como Gerente General de una tienda departamental transnacional en México.



GASTÓN HUERTA

Fraud Risk Manager

CITI



Faculty

El Prof. Luis Seco es el Director del Programa de Finanzas Matemáticas, Profesor de Matemáticas en la Universidad de Toronto y Director de Risklab, un laboratorio de investigación universitario establecido en 1996, que realiza investigaciones en finanzas cuantitativas, con un enfoque especial en la gestión de activos.

En octubre de 2007, RiskLab ganó el premio Synergy Award for Innovation de NSERC (Consejo de Investigación de Ciencias Naturales e Ingeniería de Canadá). El premio fue entregado por el Dr. Colin Carrie, Secretario Parlamentario del Ministro de Industria, en nombre del Honorable Jim Prentice, Ministro de Industria y Ministro responsable del Consejo de Investigación de Ciencias Naturales e Ingeniería de Canadá (NSERC), y por la Dra. Suzanne Fortier, presidenta de NSERC. Ha sido el fundador y Director General de Sigma Analysis & Management Ltd., una empresa de gestión de activos que invirtió dinero institucional en productos de fondos de cobertura durante veinte años.

En la actualidad, los socios comerciales de Prof. Seco incluye varios fondos soberanos y de pensiones internacionales, FIT Center Ltd., RiskLab Center Inc., Metaversitas Inc. y JUMP S.a.r.l., para abordar los desafíos y lograr una agenda de innovación.

Su visión es aprovechar la red de universidades en todo el mundo para promover la formación y la investigación ampliamente en las áreas donde la tecnología y la innovación se unen a las finanzas, incluida la educación.

La carrera de Luis Seco comenzó en la Universidad de Princeton en 1985 y aterrizó en la Universidad de Toronto en 1992 después de una breve estancia en el Instituto de Tecnología de California.



LUIS SECO

Toronto University

Risklab



Faculty



MYRIAM CISNEROS

Gerente de Avalúos

INFONAVIT

Tiene cerca de 15 años de experiencia en el medio financiero, en áreas de administración de riesgos, estructuración y análisis crediticio y de mercados; donde 10 de éstos han sido en el sector vivienda. En temas energéticos cuenta con más de 11 años de experiencia. Ha trabajado tanto en el sector privado como el público en instituciones como Infonavit, Sociedad Hipotecaria Federal, Banobras, Comisión Nacional de Vivienda, Banco de México, Commerz Bank, Secretaría de Energía, Instituto Mexicano del Petróleo e Indigopool solutions/ Schlumberger. Doctora en matemáticas financieras por la Universidad de Oxford (Inglaterra), Maestra en matemáticas industriales por la Universidad de Kaiserslautern (Alemania) y licenciada en matemáticas por la Universidad de Sonora. Cursó el programa ejecutivo #MujeresQueTransforman por la Asociación de Bancos de México y Escuela de finanzas Afi. Cuenta con diplomados en: Mercados Financieros y Riesgos, Liderazgo en Desarrollo Sustentable (LEAD Internacional), Internacional en Desarrollo Sustentable y Derecho Ambiental (DESDEA) y un Curso de Experto en Derecho Urbano.

Tiene diversas publicaciones y ha recibido varios premios académicos. Asimismo, ha sido consultora para PEMEX y el Banco Mundial. En lo académico, ha impartido cursos para el programa doctoral del Instituto Mexicano del Petróleo, participado en varios cursos a nivel licenciatura en matemáticas aplicadas y de maestría en finanzas matemáticas en la Universidad de Oxford, impartido varios cursos en la maestría de Gestión de la Industria Petrolera en la Universidad Politécnica del Golfo de México; co-asesora de tesis de Maestría Matemáticas Aplicadas e Industriales, asesora de una tesis de Maestría en Finanzas que ganó el 1er. Lugar del IMEF en la categoría de Investigación Financiera Empresarial y co-asesora de una tesis doctoral en Matemáticas Aplicadas y Computación; evaluadora de proyectos de investigación para el Consejo Nacional de Ciencia y Tecnología, entre otros. Ha impartido varios cursos y pláticas en materia de crédito y garantías, modelos estadísticos y matemáticos, cambio climático y sector petrolero, entre otros. Miembro del movimiento Líderes que Inspiran con un capítulo en el libro “Mujeres Inspirando a Mujeres. Historias de Vida”.



Faculty

Especialista Certificado, Conferencista, Consultor Internacional y Académico; especialista en temas corporativos, compliance, gestión de riesgos y financieros, entre otras.

Cuenta con estudios de postgrado entre los que destacan el Máster en del derecho penal económico, el de seguridad de bienes y personas y el Iberoamericano en Compliance por la Universidad de Salamanca España.

Sandro García-Rojas ha sido representante de México en diversos organismos y foros internacionales como las Naciones Unidas, el GAFI, el Consejo de Europa, la OCDE, Eurojust, entre otros.



SANDRO GARCÍA-ROJAS

Consultor Internacional

(Lex-Quo)

Destacan sus participaciones en temas tales como el combate a la corrupción, el lavado de dinero, el terrorismo y su financiamiento, el combate a la delincuencia organizada y la cooperación internacional, consultoría Internacional en materia de prevención de lavado de dinero y enfoque basado en riesgos en colaboración con GAFILAT y el Banco Centroamericano de Integración Económica y evaluaciones mutuas de GAFI.

Ha ejercido la profesión tanto en el sector público como en el privado. Por más de 8 años trabajó como regulador y supervisor del Sistema Financiero Mexicano en la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, habiendo sido previamente el Titular de la Unidad de Asuntos Internacionales de la entonces Procuraduría General de la República, así como Agregado ante la Unión Europea y Suiza. Actualmente es Socio Fundador y Consultor Internacional del despacho LEX-QUO S.C.

Reconocido conferencista y profesor universitario por más de 25 años en México, América Latina y Europa, columnista y articulista, cuenta cuentos, en fin, Sandro García-Rojas ha sido autor de diversos artículos y destaca el Libro “Prevención de operaciones con recursos de procedencia ilícita en México”, en coautoría con Santiago Nieto Castillo y Karla Valenzuela Pérez, participo en el libro “Una Visión Interdisciplinaria en el Combate a la Corrupción” en coordinación de Sergio Eduardo Huacuja Betancourt.



Faculty



SURESH SANKARAN

CEO

KKCL Consulting LTD

Suresh Sankaran is the Chief Executive Officer of KKCL Consulting Ltd., an organisation providing niche bespoke risk management consulting services for the financial services segment, and primarily focuses on credit, liquidity, and model risks, as well as economic capital allocation models. He is an acknowledged subject-matter expert and he, along with a team of expert consultants, provides practitioner-based services to two-thirds of the top banks around the world as well as providing certified risk management training courses. Prior to this, Suresh was invited to join as the Head of Model Risk & Governance at Metro Bank in March 2020, where he oversaw all aspects of model risk and other risk-related governance. He advised on factors that the Board should collectively consider when overseeing the bank's risk management framework and policies. Earlier, he was with Kamakura Corporation as Principal Risk Officer, where he drove forward key aspects of a niche advisory services function whilst simultaneously developing a trusted advisory role and winning new business, and for developing a talented and expanding team. Before Kamakura, Suresh was the Principal Operations Officer for the International Finance Corporation, part of the World Bank Group, where he worked with the private sector and with governments of developing economies to develop risk infrastructure in these countries. Prior to that, he managed consulting services with Fiserv Inc., for Europe, Middle East, & Asia, was with ABN-AMRO as Regional Risk Manager, and with HSBC as Regional MIS Co-ordinator. He started his career with KPMG as a Consulting Manager. Suresh has over 34 years' experience in the realm of banking, financial services, strategic consulting, compliance, audit, and all facets of risk management. He has held leadership roles managing significant areas of risk management, most notably credit, liquidity, model risk, and balance sheet management. Suresh has also advised banks, governments, and other financial services organisations on various aspects of risk management and has functioned as a second pair of eyes to assure the soundness and financial sustainability of client portfolios. Suresh is a ranking Chartered Accountant (Intermediate countrywide 27th rank and Finals, countrywide 18th rank), and holds a bachelor's degree in finance & accountancy. He has diverse interests including Indian Classical Music, Skydiving, P G Wodehouse, and Pink Floyd.

Diplomado en Administración de Riesgos

TEMARIO



Módulo I

Risk Management Fundamentals: Global View

Lecturer: Luis Seco

Toronto University / Risklab

3 Clase (6 Horas)



Parte 1: Administración de riesgos por sector

1. Bancario
2. Seguro
3. Gestión de activos
4. Riesgos no financieros en la industria financiera

Parte 2: Banca

1. Basilea
2. Riesgo de Mercado
3. Riesgo de crédito
4. Riesgo operacional
5. Riesgo de liquidez
6. Riesgo legal

Parte 3: Solvencia de seguros II

Parte 4: Gestión de activos

1. SEC y la ley del asesor de 1933 Dodd-Frank
2. Volcker

Parte 5: Regulación por geografías

1. Estados Unidos
2. Europa (OICVM y MIFID)
3. Latam
4. Oriente Medio y Asia

Módulo II

Fixed Income (Estructura y Valuación)

Lecturer: José María De La Torre

Independent Financial Professional

8 Clase (16 Horas) 

1. Mercado de Renta Fija en México
2. Clasificación de los Instrumentos
3. Dinero en el tiempo
4. Cálculo de Bonos
5. Duración y Duración Modificada
6. Convexidad
7. DV01
8. Subastas Primarias de Banxico
9. Bonos Bullet vs. otras estructuras

Módulo III

Riesgo de Crédito (Retail y Portfolio)

Lecturer: Myriam Cisneros

Gerente de Avalúos - INFONAVIT

8 Clases (16 Horas)



Sesión 1: Fundamentales e introducción al riesgo de crédito

1. ¿Qué es el riesgo de crédito y cómo se mide?
 - 1.1. Probabilidad de incumplimiento
 - 1.2. Severidad de la pérdida
 - 1.3. Exposición al incumplimiento
2. ¿Por qué es importante medir el riesgo de crédito?
3. Métodos tradicionales y necesarios
 - 3.1. Análisis tradicional
 - 3.1.1. Las 5Cs
 - 3.1.2. Capacidad de pago/ riesgo de crédito
 - 3.1.3. Análisis cualitativo y cuantitativo de la contraparte
 - 3.1.4. Basilea I
4. Mercados financieros y riesgo de crédito
5. Credit ratings: agencias

- 3.1. Modelo de Merton
- 3.2. Longstaff & Schwartz
- 3.3. Modelo Leland & Toft
- 3.4. Modelo KMV

4. Modelos reducidos
 - 4.1. Modelo de intensidad

Sesión 3: Modelos tipo scoring y riesgo de crédito en la originación

1. Modelos tipo de scoring
 - 1.1. Generalidades
 - 1.2. Para originación y para seguimiento
 - 1.2.1. Consumo
 - 1.2.2. Hipotecas
 - 1.2.3. Créditos puente a la construcción.
2. Conclusiones de los modelos

Sesión 2: Modelos para medición de riesgo de crédito

1. Motivación de por qué medir el riesgo de crédito y contagio
2. Basel y el capital económico
3. Modelos estructurales

3. Origenación de crédito
 - 3.1. Crédito comercial (Empresas)
 - 3.2. Estados financieros/balance general y proyecciones
 - 3.3. Conocer ciclo de negocio: ejemplos desarrolladores de vivienda
 - 3.4. Enaltecadores crediticios por tipo de operación
 - 3.5. Covenants

4. Crédito Individual (Personas)
 - 4.5.1. Conocer a los potenciales acreditados
 - 4.5.2. Crédito hipotecario y de consumo
 - 4.5.3. Tabla de amortización
 - 4.5.4. Enaltecadores crediticios por tipo de operación
 - 4.5.5. Costo-beneficio de enaltecadores
 - 4.5.6. Covenants

Sesión 4: Correlación de impagos y recuperación de créditos

1. Fundamentales de recuperación de los créditos
 - 1.1. Reestructuras
 - 1.1.1. Caso de estudio 1
 - 1.1.2. Tasa de recuperación en modelos estructurales
 - 1.1.3. Tasa de recuperación en modelos reducidos
 - 1.1.4. Modelos con correlación entre PI y RR
2. Severidad de la Pérdida
 - 2.1. Estudio de severidad de la pérdida de créditos hipotecarios

Sesión 5: Derivados de crédito

1. Derivados de crédito y riesgo
 - 1.1. Credit Default Swaps (CDS)
 - 1.2. Bonos convertibles (CB)
 - 1.3. Bonos Coco (BCoCo)
 - 1.4. Caso de estudio
 - 1.5. Covered bonds (CoB)
 - 1.6. Collateral Debt Obligation (CDO)

2. Discusión de temas

Sesión 6: Modelos para riesgo de crédito de portafolios

1. Credit VaR
2. CreditMetrics
3. CreditRisk+
4. KMV
5. Otros modelos
6. Comparación entre modelos

Sesión 7: Administración de riesgo de crédito de portafolios

1. Administración de portafolio de créditos y modelos
 - 1.1. Administración y cobranza como mitigación de RC
 - 1.2. Análisis vintage
 - 1.3. Análisis de roll rate
2. Modelos para riesgo de crédito de portafolios
 - 2.1. Cadenas de Markov aplicado a RC
3. Medidas de desempeño ajustados a riesgo
4. Medidas de concentración de portafolios

Sesión 8: Contraparte, stresstesting, backtesting y otros

1. Introducción
2. Riesgo de crédito de contrapartes
3. Stress testing
 - 3.1. IFRS9 vs Basel
 - 3.2. Climate risk in risk management
4. Backtesting

Módulo IV

Currencias (Fx Markets)

Lecturer: Antonio Castaño

Director de Tesorería / CIBanco

5 Clases (10 Horas)



1. Breve historia del mercado de divisas
2. La economía detrás del mercado de divisas y el comercio internacional
3. El mercado de divisas al contado
4. Forwards y futuros
5. Opciones
6. Crisis monetarias
7. El mercado de divisas en México

Módulo V

Equity Analysis and ETFs

Lecturer: Mariana Garza

Co-Head Intermediarios & FO de Compass México

5 Clases (10 Horas)



1. El sistema financiero:
 - 1.1. El sistema financiero México/ EU
 - 1.2. Tipos de activos y mercados
 - 1.2.1. Valores
 - 1.2.2. Bonos
 - 1.2.3. Dinero
 - 1.2.4. Cambiario
 - 1.2.5. Exchange Traded Funds (ETFs)
 - 1.3. El mercado de valores México/ EU
 - 1.3.1. Bolsa de Valores de México
 - 1.3.2. New York Stock Exchange
 - 1.3.3. Instrumentos del mercado de valores
2. Análisis fundamental
 - 2.1. Análisis del entorno macroeconómico
 - 2.1.1. Crecimiento y valor
 - 2.1.2. Fuentes internas y externas de crecimiento
 - 2.1.3. Inflación
 - 2.1.4. Política monetaria
 - 2.1.5. Otras variables relevantes
 - 2.2. Impactos macroeconómicos sobre el mercado de valores
 - 2.3. Análisis sectorial
 - 2.4. Impulso externo
 - 2.5. Impulso fiscal
 - 2.6. Desempeño de las empresas
 - 2.6.1. Valuación
 - 2.6.2. Múltiplos y razones financieras y bursátiles
 - 2.6.3. El impacto de la política monetaria y las condiciones de crédito
 - 2.6.4. Elección de emisoras
 - 2.6.5. Análisis sectorial
 - 2.6.6. Índices agregados
3. Análisis técnico

- 3.1. Supuestos y lógica del análisis técnico – Comparación con el fundamental
- 3.2. Principales tipos de gráficas
- 3.3. Principales elementos de las tendencias
 - 3.3.1. Soporte
 - 3.3.2. Resistencia
 - 3.3.3. Volumen
- 3.4. Indicadores y filtros relevantes
- 4. Teoría de portafolios de inversión
 - 4.1. Conceptos generales
 - 4.2. Factores y cálculo del coeficiente beta
 - 4.3. Capital Asset Pricing Model (CAPM) y línea eficiente
- 5. Introducción al mercado derivados
 - 5.1. Análisis de riesgo
 - 5.2. Forwards
 - 5.3. Futuros
 - 5.4. Opciones
 - 5.5. Swaps
- 6. Principales temas de actualidad del mercado de valores
 - 6.1. Volatilidad
 - 6.2. Sectores con desempeño sobresaliente
 - 6.3. Inflación y Reserva Federal
 - 6.4. Desempeño de las empresas
 - 6.4.1. Valuación
 - 6.4.2. Múltiplos y razones financieras y bursátiles
 - 6.4.3. El impacto de la política monetaria y las condiciones de crédito
 - 6.4.4. Elección de emisoras
 - 6.4.5. Análisis sectorial
 - 6.4.6. Índices agregados

Módulo VI

Riesgo de Mercado (Trading Floors & Risk Management Staff)

6 Clases (12 Horas)



1. La función de la Gestión de Riesgos
 - 1.1. Definiciones y conceptos esenciales
 - 1.2. Clasificación de los riesgos financieros
 - 1.3. El proceso de administración de riesgos
 - 1.4. Administración de riesgos en el proceso de inversión
 - 1.5. 2008 la crisis de credito y el contagio sistémico
2. Análisis de Riesgos y Rendimientos
 - 2.1. Análisis de spreads y correlación
 - 2.2. Optimización de portafolios
 - 2.3. Análisis de desempeño ajustado por riesgo
 - 2.4. Atribución de desempeño (Performance Attribution)
3. Volatilidad
 - 3.1. Definiciones y conceptos
 - 3.2. Análisis modelos de volatilidad
 - 3.3. Volatilidad histórica
 - 3.4. Volatilidad dinámica (Exponential Weighted Moving Average)
 - 3.5. Volatilidad implícita
 - 3.6. Comparación de modelos, ventajas y desventajas
 - 3.7. Criterios para la selección de un sistema de gestión de riesgos
 - 3.8. Volatilidad de tasas de interés
 - 3.9. Volatilidad de FX
 - 3.10. Volatilidad de índices y acciones
4. Valor en Riesgo (Value At Risk)
 - 4.1. Definiciones y conceptos
 - 4.2. Desagregación de Riesgos
 - 4.3. VaR Condicional, VaR Marginal, VaR Incremental y Var por Componentes

- 4.4. VaR Paramétrico
 - 4.5. Simulación Histórica y Simulación Montecarlo
 - 4.6. Aplicación pasiva, defensiva y activa
 - 4.7. Definición de límites para gestión de riesgo
 - 4.8. Estimación de rendimiento esperado por unidad de riesgo (Risk Budget Analysis)
 - 4.9. Ejercicios de Cálculo de VaR para portafolios de acciones, bonos, FX y Derivados (Modelos Paramétrico, Histórico y Montecarlo)
5. Análisis de riesgos para instrumentos de deuda
- 5.1. Estructura de tasas de interés
 - 5.2. Teoría de expectativas, segmentación de mercados y preferencia de liquidez
 - 5.3. Sensibilidades: duración y convexidad (Aproximación Delta -Gamma)
 - 5.4. VaR para instrumentos de deuda
 - 5.5. Análisis de duración por nodos (Key Rate Duration)
 - 5.6. ¿Qué deben de considerar en la Mesa de Mercado de Dinero?
 - 5.7. Ejercicios y aplicaciones en la gestión de portafolios
 - 5.8. Reportes de Riesgo de Mercado al Head Trader y CRO
6. Market Risk in Trading Derivatives Desk
- 6.1. Instrumentos Financieros Derivados
 - 6.2. Riesgos asociados
 - 6.3. Sensibilidades (Griegas)
 - 6.4. DELTA
 - 6.5. GAMMA
 - 6.6. RHO
 - 6.7. TETA
 - 6.8. VEGA
 - 6.9. Reportes de Riesgo de Mercado en Derivados al Head Trader y CRO
7. Prueba retrospectiva de modelo (Back testing)
- 7.1. Estadístico Kupiec
 - 7.2. Ajuste de modelos de riesgo
8. Prueba de estrés
- 8.1. Generación y análisis de escenarios de estrés
 - 8.2. Asignación de probabilidades
 - 8.3. Análisis uni-factorial
 - 8.4. Análisis multi-factorial
 - 8.5. Generación y análisis de escenarios futuros (Horizon Analysis)

Módulo VII

CVA & xVA:Pricing, Hedging & Trading

Lecturer: Giovanni Negrete

Director, xVA Desk - Banco Santander

5 Clases (10 Horas)



Parte I Derivados de crédito: productos y valuación

1. Productos
 - 1.1. Riesgo de Mercado vs. Riesgo de Crédito
 - 1.2. Derivados de Crédito
2. Single-name credit derivatives
 - 2.1. Credit Default Swap
 - 2.2. Total Rate of Return Swap
 - 2.3. Credit spread forwards and options
 - 2.4. Credit Linked Notes
3. Multiname, basket or portfolio credit derivatives
 - 3.1. Basket Default swaps
 - 3.2. CDO's
 - 3.3. Index products (CDX, iTraxx, etc.) Valuación
4. Modelos estructurales
 - 4.1. Merton

Parte II. Credit Value Adjustment (CVA)

5. La importancia del Riesgo de Contraparte y CVA después de la Crisis 2008
6. Definición de Riesgo de Contraparte e Introducción a Riesgo de Crédito
7. Riesgo de Crédito vs. Riesgo de Contraparte
8. Componentes Fundamentales: Exposición, Probabilidad de Incumplimiento
9. Severidad de la Pérdida y Mitigantes
10. Modelos de Riesgo de Exposición de Basilea II
11. La Valuación del Riesgo de Contraparte y el Credit Value Adjustment (CVA)
12. Otros tópicos clave como el Wrong Way Risk

Módulo VIII

Liquidity & FTP

Lecturer: Suresh Sankaran

CEO - KKCL Consulting LTD

2 Clases (14 Horas)



1. Understanding the nature of liquidity risk
 - 1.1. Definition, understanding of liquidity
 - 1.2. Pools of liquidity, and illiquid assets
 - 1.3. Market conventions
2. Building a framework for liquidity management
 - 2.1. Mismatch approach
 - 2.2. Foreign currency liquidity management
 - 2.3. Internal controls for liquidity risk management stress testing
 - 2.4. Internal controls for liquidity risk management: scenario analysis
3. Liquidity contingency planning
 - 3.1. The need for contingency planning
 - 3.2. Written contingency plans
 - 3.3. Crisis management plans for assets
 - 3.4. Crisis management plans for liabilities
 - 3.5. Internal and external communications
 - 3.6. Other crisis management issues
4. Liquidity stress-testing
 - 4.1. Why stress test liquidity
 - 4.2. General considerations
 - 4.3. Empiricism versus rocket science
 - 4.4. Current stress test priorities
 - 4.5. Assumption sensitivity
 - 4.6. Additional considerations
5. Measuring market risk – Liquidity adjusted Value at risk (LVAR)
 - 5.1. Definitions
 - 5.2. Using liquidity-adjusted VAR to manage risk
 - 5.3. Limitations of standard VAR measures to assess liquidity
6. The incorporation of credit in the liquidity risk framework
 - 6.1. Cash-flows adjusted for credit
 - 6.2. The recovery process
 - 6.3. Credit in funding and market liquidity
 - 6.4. Credit-adjusted liquidity analytics
7. Northern Rock – A case study on liquidity
 - 7.1. What caused the failure of Northern Rock
 - 7.2. The structure of syndication, securitisation, and so many other ions
 - 7.3. The history of Northern Wreck

Módulo IX

Derivados

8 Clases (16 Horas)



1. Introducción a los derivados
 - 1.1. Definición y derivados más comunes
 - 1.2. ¿Dónde se encuentran? y determinantes de la oferta
 - 1.3. Modelos de operación (OTC, “exchanges”)
 - 1.4. Tamaño y características del mercado
 - 1.5. Papel de los derivados en la economía
 - 1.6. Aplicaciones
2. Valuación por el principio de no arbitraje
 - 2.1. Definiciones
 - 2.2. Ley de un solo precio
 - 2.3. Fórmula general de valuación
 - 2.4. Diagramas de pagos de un derivado
3. Forwards y Futuros
 - 3.1. Definiciones
 - 3.2. Evolución y crecimiento del mercado
 - 3.3. Diagramas de pagos y evolución
 - 3.4. “Mark to market” y requerimientos de margen
 - 3.5. El concepto de base y el efecto de apalancamiento
 - 3.5.1. Ejemplo práctico de operación en el CME
 - 3.6. Futuros de materias primas
 - 3.6.1. “Convenience yield” y cheapest to deliver
 - 3.6.2. Oro, petróleo, etc
 - 3.6.3. Curvas de precios (“Contango”- “Backwardation”)
 - 3.6.4. Características de entrega Futuros financieros
 - 3.6.5. Acciones
 - 3.6.6. Renta Fija
 - Futuros de bonos
 - Eurodollar
 - Fed Funds
 - 3.6.7. Divisas
- 3.7. Coberturas
4. Swaps
 - 4.1. Definiciones
 - 4.2. Evolución y crecimiento el mercado
 - 4.3. Swaps de tasas de interés (IRS)
 - 4.4. FX swaps
 - 4.5. Asset swaps
 - 4.6. Swaps de inflación
5. Valuación de Swaps
 - 5.1. Repaso de la curva de rendimiento
 - 5.2. Factores de descuento
 - 5.3. Tasa forward
 - 5.4. Valuación
 - 5.5. Colateralización y valuación con OIS
6. Introducción a derivados de crédito
 - 6.1. Exposición a riesgo de

crédito.

- 6.2. Función económica.
- 6.3. El mercado de derivados de crédito.
- 6.4. Tipos de derivados de crédito.
- 6.5. Índices

7. Opciones

- 7.1. Definiciones y conceptos básicos
- 7.2. Características del contrato
- 7.3. Otras definiciones: (prima, valor intrínseco, time value)
- 7.4. Diagrama de pagos y estrategias
- 7.5. Diagramas de P/L
- 7.6. Usos y estrategias

7.7. Valuación

- 7.7.1. Determinantes del precio de una opción
- 7.7.2. Principio de no arbitraje
- 7.7.3. Ley de un solo precio
- 7.7.4. Tipos de modelos de valuación
 - Fórmulas cerradas
 - Valuación binomial
 - Método Monte-Carlo
 - El árbol binomial

7.8. Paridad Put-Call

- 7.9. Volatilidad y sensibilidades
 - Histórica
 - Implícita
 - Introducción a la sonrisa de volatilidad
 - Sensibilidades (griegas)

Módulo X

Operational Risk Management

Lecturer: Arturo Ávila Sánchez

Responsable de Riesgo Operacional, Legal, Tecnológico y Continuidad de Negocio

5 Clases (10 Horas)



Presentación del curso e introducción

Objetivos del curso. El registro de riesgos. Mapas de calor: porqué no sirven. Análisis de riesgos cuantitativo. Comprendiendo la simulación Monte Carlo.

Creación del registro de riesgos

Comprendiendo los componentes de frecuencia y severidad en un modelo cuantitativo de registros de riesgo. Estructuración completa del modelo cuantitativo.

Ejecutando la simulación Monte Carlo e interpretación de resultados

Pasos para la ejecución de la simulación Monte Carlo. Interpretando histogramas, curvas S, tornados y gráficos de dispersión y tabla de datos.

Convergencia, gráficos y otros

Cuántas iteraciones ejecutar en una simulación (convergencia), escogencia de distribuciones. Repaso de funciones de frecuencia y severidad, repaso de interpretación de gráficos.

Estrategias de mitigación y conclusiones

Una vez determinados los riesgos más significativos, procedemos a evaluar estrategias de mitigación alternativas, sus costos, sus disyuntivas y la forma correcta de analizarlas. Comparación de alternativas de software: IziRisk, @RISK.

Módulo XI

Stress Tests and Capital Planning

Lecturer: Suresh Sankaran

CEO - KKCL Consulting LTD

5 Clases (10 Horas)



1. Historical evolution of stress tests and economic capital calculations
2. Scenario-based stress test
3. Reverse stress test
4. Risk identification
5. Parameters to assess capital adequacy
6. Capital planning over specified horizon
7. Models for market risk
8. Models for credit risk
9. Models for operational risk
10. Models for revenues, expenses and profits
11. Model risk and model risk management in stress testing
12. Communication of the results of the tests to senior management and regulators
13. The successful experience of DFAST/CCAR
14. The trends going forward

Módulo XII

Fraud Risk Management

Lecturer: Gastón Huerta

Fraud Risk Manager - CITI

4 Clases (8 Horas)

1. Cifras importantes sobre el Fraude
2. Historia del Fraude
3. ¿Qué es el fraude realmente?... Y sus definiciones
4. ¿A qué nos enfrentamos?
5. Los diferentes tipos de fraude
6. Diferentes factores relacionados al fraude
7. El Triángulo del Fraude y sus componentes
8. La Psicología del defraudador
9. Internet, Cybercrimen y Cyberseguridad
10. Como funcionan las estructuras del Cybercrimen
11. Tendencias globales del fraude
12. Consecuencias del fraude
13. Enfrentando y controlando el fraude
14. Responsabilidades Institucionales
15. Programa Integral de Administración de Fraudes
16. Las mejores prácticas y estrategias para combatirlo
17. Los mínimos estándares que se deberían cumplir
18. Como detectar y evaluar vulnerabilidades
19. Como medir, controlar y administrar el fraude
20. Sistemas, herramientas y modelos para combatir el fraude
21. Casos prácticos

Módulo XIII

Financial Crimes & Compliance

Lecturer: Sandro García

Consultor Internacional - (Lex-Quo)

4 Clases (8 Horas)

1. Nadie puede prevenir lo que no conoce:
 - 1.1. ¿Qué es el riesgo?
 - 1.2. Tipos de Riesgo
 - 1.3. Por qué un enfoque Basado en Riesgos.
 - 1.4. Matrices de Riesgo- calibrando el nivel de riesgo ante la incertidumbre.
 - 1.5. Inteligencia Artificial. Los nuevos riesgos
 - 1.6. Riesgos Emergentes
 - 1.7. Nueva Evaluación Nacional de Riesgo en México
 - 1.8. Quinta Ronda de Evaluación Mutua GAFI.
 - 1.9. ¿Qué hacer? ¿Qué esperar?
2. Compliance Integral (Gestión de Riesgos)
 - 2.1. Modelo de Capacidad (Gobernanza-Riesgo-Compliance)
 - 2.2. Modelo COSO de Gestión de Riesgos
 - 2.3. Modelo de las Tres líneas de Defensa
3. Medidas Preventivas en la Gestión de Riesgos
 - 3.1. Emergency continuity plan
 - 3.2. Gestión de Riesgos desde la Alta Dirección (tone at the top)
 - 3.3. Estrategias de inteligencia y apetito de riesgo
 - 3.4. Herramientas para la Gestión de Riesgos y aplicación en la empresa

Módulo XIV

UAIR (Unidad Integral de Administración de Riesgos)

Lecturer: Andrés Corona

CEO - Monte de Piedad

4 Clases (8 Horas)

1. ¿Cuáles son las Funciones y Estructura óptima de la UAIR?
2. ¿Cómo integrar y analizar el Perfil de Riesgos de la Institución-Mapa de Capital?
3. ¿Hasta dónde debe llegar Marco para la Administración Integral de Riesgos?
4. ¿Cómo definir el “Apetito de Riesgo” y los Límites de Exposición al Riesgo?
5. ¿Cómo seleccionar los Niveles de Tolerancia al Riesgo por UN y Factor de Riesgo?
6. ¿Qué incluir y cómo medir los Riesgos No Discrecionales (R. Operativo, R. Tecnológico y R. Legal)?
7. ¿Cómo gestionar los Riesgos No Cuantificables (R. Estratégico, R. de Negocio y R. Reputacional)?
8. ¿Cómo optimizar APR's y los Requerimientos Regulatorios de Capital?
9. ¿Cómo integrar las Proyecciones de Capital y realizar Análisis de Sensibilidad y Escenarios de Estrés?
10. ¿Qué hay que analizar en el informe de Evaluación de Suficiencia de Capital?
11. ¿Cómo analizar los Indicadores de Riesgo de Liquidez?
12. ¿Cuál es el alcance de los Planes de Contingencia y de Financiamiento de Contingencia?
13. ¿Cómo hacer la valuación, medición y control de riesgo de nuevos productos y servicios?
14. ¿Qué elementos clave en materia de capital humano se deben de considerar para conformar la UAIR?
15. BEm y su entorno de crecimiento y competencia
16. Gobierno de la función de riesgos en México
17. Principios directores del apetito de riesgo y la gestión de valor
18. Cálculo de requerimientos de capital
19. Rentabilidad y alineación de incentivos
20. Conclusiones



Testimonials



ABRAHAM GÓMEZ

Gerente de Riesgos de
Liquidez y Capitalización

CIBanco

“Considero que el programa aborda temas de actualidad, prácticos en el día a día en lo que respecta a la Administración de Riesgos Financieros y el cual representa un complemento ideal en el proceso de formación continua de los profesionales en la materia.”



ANTONIO SILVA

Banxico

“Los mejores profesores del medio lo hacen único”

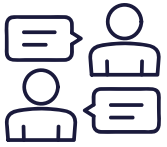


VERÓNICA CÓRDOVA

Gerente de riesgo de
mercado para fondos de
inversión y otras filiales

Banorte

“El diplomado brinda una visión de 360 grados, considera actualizar conocimientos en sistemas robustos, desarrollar la aplicación de metodologías vigentes, eficientes y respaldo profesores con amplia experiencia en temas actuales en riesgos.”



Testimonials



JORGE MANUEL CELIS

Subdirector de Ventas
Institucionales

Casa de Bolsa Banorte

“Este diplomado superó ampliamente mis expectativas. Buena distribución del programa 65% cuantitativo, 35% cualitativo.

Nos enseñaron desde diferentes lenguajes de programación (r, stata, python), la importancia de la gestión de riesgos y el caso Barings Bank.”



RAYMUNDO JOSÉ

BANAMEX

“Es un programa muy completo, práctico y enfocado en temas que están revolucionando al mundo financiero.

Sin duda, este Programa ayuda mucho en el entendimiento de los productos Derivados, su relevancia en los mercados actuales y la importancia en las nuevas formas de hacer negocio”

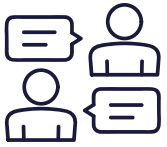


ROBERTO MOURET

Jefe de Oficina
de Sanciones

Banxico

“Es un programa 100% práctico; sin duda, el mejor complemento para un Quant”



Testimonials



PABLO MARTÍNEZ

Banxico

“Los mejores profesores lo hacen el curso más completo, donde aprendes de la A a la Z el pricing, modeling y trading de los derivados.”



JAIME ADRIÁN RÍOS

Subdirector de Riesgo
de Crédito

BanCoppel

“Todo profesional que labore en el ámbito de la Administración de Riesgos debe tomar este Diplomado ya que otorga una gran variedad de conocimientos y herramientas necesarias para enfrentar los Riesgos actuales y futuros de las diversas compañías en el ámbito financiero.

Me otorgó un abanico de conocimientos en todas las ramas del Riesgo Financiero y Operacional los cuales son aplicables dado que las clases contienen contenido teórico y práctico. Se tocan los temas actuales en el ámbito de riesgo lo que me ayudó a actualizarme en varios temas, lo cual es de suma importancia para nuestra profesión de la Gestión del Riesgo.”



	Módulo	Módulo	Horas	Sesiones	Instructor	Puesto - Institución	Horario
■	I	Risk Management Fundamentals: Global View	6	3	Luis Seco	Toronto University Risklab	18:00 - 20:00 H
■	II	Fixed Income (Estructura y Valuación)	16	8	José María De La Torre	Independent Financial Professional	19:00 - 21:00 H
■	III	Riesgo de Crédito (Retail y Portfolio)	16	8	Myriam Cisneros Molina	Gerente de Avalúos INFONAVIT	19:00 - 21:00 H
■	IV	Currencies (Fx Markets)	10	5	Antonio Castaño	Director de Tesorería CIBANCO	19:00 - 21:00 H
■	V	Equity Analysis and ETFs	10	5	Mariana Garza	Co-Head Intermediarios & FO Compass México	19:00 - 21:00 H
■	VI	Riesgo de Mercado (Trading Floors & Risk Management Staff)	12	6			
■	VII	CVA & xVA: Pricing, Hedging & Trading	10	5	Giovanni Negrete	Director, xVA Desk Banco Santander	18:00 - 20:00 H
■	VIII	Liquidity Risk & FTP (RMTC PARA 2025)	14	2	Suresh Sankaran	Head of Model Risk & Governance Metro Bank	10:00 - 17:00 H
■	IX	Derivados	16	8			18:00 - 20:00 H
■	X	Operational Risk Management	10	5	Arturo Ávila Sánchez	Responsable de Riesgo Operacional, Legal, Tecnológico y Continuidad de Negocio	18:00 - 20:00 H
■	XI	Stress tests and capital planning	10	5	Suresh Sankaran	Head of Model Risk & Governance Metro Bank	18:00 - 20:00 H
■	XII	Fraud Risk Management	8	4	Gastón Huerta	Fraud Risk Manager CITI	19:00 - 21:00 H
■	XIII	Financial Crimes & Compliance	8	4	Sandro García	Consultor Internacional (Lex-Quo)	19:00 - 21:00 H
■	XIV	UAIR (Unidad Integral de Administración de Riesgos)	8	4	Andrés Corona	CRO -Monte de Piedad	19:00 - 21:00 H
TOTAL			154	72			

Calendario 2025

Marzo

D	L	M	M	J	V	S
						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10	11	12	13	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	24	25	26	27	28	29
30	31					

Abril

D	L	M	M	J	V	S
		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30			

Mayo

D	L	M	M	J	V	S
				1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	31

Junio

D	L	M	M	J	V	S
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30					

Julio

D	L	M	M	J	V	S
		1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30	31		

Agosto

D	L	M	M	J	V	S
					1	2
3	4	5	6	7	8	9
10	11	12	13	14	15	16
17	18	19	20	21	22	23
24	25	26	27	28	29	30
31						

Septiembre

D	L	M	M	J	V	S
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19	20
21	22	23	24	25	26	27
28	29	30				

Octubre

D	L	M	M	J	V	S
			1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	23	24	25
26	27	28	29	30	31	

Noviembre

D	L	M	M	J	V	S
						1
2	3	4	5	6	7	8
9	10	11	12	13	14	15
16	17	18	19	20	21	22
23	24	25	26	27	28	29
30						

Diciembre

D	L	M	M	J	V	S
	1	2	3	4	5	6
7	8	9	10	11	12	13
14	15	16	17	18	19	20
21	22	23	24	25	26	27
28	29	30	31			



VIRTUAL / LIVE

FORMAS DE PAGO

TRANSFERENCIAS EN MXN

BANCO: BBVA
 BENEFICIARIO: RISKMATRICS
 FINANCIAL INSTITUTE SAPI CV
 NO. DE CUENTA: 0123457230
 CLABE: 012180001234572305

TRANSFERENCIAS EN USD

BANCO: BBVA
 BENEFICIARIO: RISKMATRICS
 FINANCIAL INSTITUTE SAPI CV
 NO. DE CUENTA: 0123457265
 CLABE: 012180001234572651
 SWIFT: BCMRMXMMPYM

PAGOS EN LÍNEA

Visita: www.riskmathics.com



Costo

\$ 115,000 MXN + IVA (16%)
 \$ 5,900 USD + TAX (16%)



Requisitos

- Se recomienda laborar en áreas Económico-Administrativas y/o de instituciones Financieras, empresas y/o corporativos
- Contar con bases de Matemáticas Financieras
- Conocer o tener nociones de los valores que se operan en los mercados de contado (Públicos): Divisas, Capital Markets y Mercado de Dinero
- De preferencia trabajar o haber trabajado en instituciones del medio financiero



Contacto e Inscripciones

México:

derivatives@riskmathics.com
 +52 55 5638 0367
 +52 55 5669 4729



Duración

154 Clases (72 Horas)

Horario:

6:00 pm a 8:00 pm (varía según el módulo)
 Hora de la Ciudad de México

*Por favor, use el [Reloj Mundial](#) para convertir el horario a su hora local.

Políticas del Servicio:

En caso de Recalendarización o Cancelación de Programas, Cambios en Fechas, Sedes y demás causas de fuerza mayor:

Es política de RiskMathics Financial Institute evitar en medida de lo posible y dentro de los estándares de la Industria Educativa cambios en fechas, sedes, expositores, horarios y de cualquiera otra índole, de cualquier programa, sin embargo; tendrá la facultad de realizar dichos cambios en el o los momentos que sean estrictamente necesarios.

En caso de que el participante se encuentre inscrito en un programa y se realice cambio alguno de los detalles antes mencionados, se le notificará con el mayor tiempo de anticipación posible, previo a la fecha en que se requiera realizar alguna modificación. Si el participante no pudiera asistir al curso por cualquier motivo, podrá comunicarlo directamente a RiskMathics Financial Institute hasta una semana antes del inicio del programa y podrá intercambiar el mismo por otro de su elección dentro del mismo rango de costo del programa al que se encontraba inscrito originalmente, o bien, podrá ceder su lugar, previamente liquidado, a otra persona que el mismo designe sin cargos adicionales.

En caso de que el participante no asista y no haya dado aviso dentro del lapso estipulado, perderá su lugar y no habrá reembolso ni devolución alguna.

No existen reembolsos ni devoluciones a excepción de que se cancele definitivamente el programa.