



**programa
especializado**

Gestión
del Riesgo
Financiero





Desarrolla los principales tópicos de riesgos financieros, desde una perspectiva de comprensión, gestión y modelación para administrar y prevenir las amenazas económicas que pudieran afectar el negocio.



En la actualidad, la gran competencia en los mercados no solo requiere empresarios audaces, sino estrategias que entiendan otros contextos y puedan asumir riesgos para hacer frente a escenarios adversos. En esa dinámica de ataque y defensa, el control del riesgo financiero resulta clave para evitar dificultades que puedan traer abajo lo avanzado.

En ese sentido, la Escuela de Postgrado de la UPC ha diseñado el Programa Especializado en Gestión del Riesgo Financiero, que brinda las técnicas y conceptos vinculados con los riesgos operativos, crediticios, de balance, liquidez y de mercado. El programa gira en torno a la medición, administración y prevención de las amenazas de orden económico que pudieran afectar el negocio.

Los alumnos estarán capacitados para cumplir los objetivos de las empresas bajo un costo inferior al proyectado. Además, gracias a la metodología práctica y el uso de herramientas y modelamiento podrán resolver problemas de forma ágil en beneficio de sus organizaciones.

Te invitamos a formar parte del programa que reúne a especialistas con experiencia en distintos sectores empresariales dispuestos a compartir todo el *know how* desarrollado en su expertise profesional y en sus empresas.

Abel García
Director del Programa

universidad peruana de ciencias aplicadas (UPC)

La exigencia nos hace innovar.

Hace más de 27 años, la **UPC revolucionó el sector de la educación superior** en el país, **innovando** y rompiendo paradigmas, redefiniendo el concepto de exigencia, a través de la búsqueda incansable de la excelencia académica y mejora continua.

WASC | Senior College and
University Commission

Acreditación internacional*

UPC es la única universidad peruana acreditada por WSCUC de los Estados Unidos de America, por el plazo máximo de 10 años bajo el mismo sistema y estándares que universidades Top 10 del mundo.

— "Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas is accredited by the WASC Senior College and University Commission (WSCUC), 985 Atlantic Avenue, Suite 100, Alameda, CA 94501, 510.748.9001."



Nº1 Internacionalización*

Por ocho años consecutivos, la UPC destaca como líder en internacionalización.

— Ranking de Las Mejores Universidades del Perú 2014, 2015, 2016, 2017, 2018, 2019, 2020 y 2021 de la revista América Economía.



escuela de postgrado de la UPC

La **UPC** está comprometida con la renovación de la alta educación de postgrado del país. Por ello, brinda una formación completamente diferente, orientada a **desarrollar líderes capaces de transformar** su entorno y los negocios en los que participe.

- **Aliados internacionales de primer nivel**

La Escuela de Postgrado de la UPC mantiene alianzas estratégicas con instituciones de prestigio como Harvard University DCE, Kellogg School of Management, Universidad Politécnica de Cataluña, entre otros.

- **Mejoras profesionales y ascensos laborales**

8 de cada 10 egresados de la Escuela de Postgrado de la UPC consiguieron mejoras profesionales y ascensos laborales.
— Ipsos Perú: Empleabilidad Postgrado 2019

- **Top 5 de escuelas de negocio**

La UPC está ubicada en el TOP5 según el Índice de Atracción que mide la preferencia de los ejecutivos respecto a la elección de escuelas de negocios para estudiar una maestría.
— Arellano marketing: Dónde Quiero Estudiar 2019

- **+7000 mil egresados**

La Escuela de Postgrado de la UPC cuenta con una gran comunidad de egresados de Maestrías y Másteres.



Visión

Ser reconocidos por formar profesionales a nivel de maestría y especialidad con las más altas competencias profesionales y con liderazgo en la transformación del Perú.



Misión

Formar profesionales, a nivel de maestría y especialidad, líderes íntegros e innovadores con visión global para que agreguen valor en las organizaciones y la sociedad, y contribuyan a transformar el Perú.

¿por qué el Programa Especializado en Gestión del Riesgo Financiero?

El programa brinda las técnicas y conceptos vinculados con los riesgos operativos, crediticios, de balance, liquidez y de mercado.



Formación de vanguardia que se centra en los fundamentos

El programa incluye tópicos de tendencia que desarrollan las bases técnicas rigurosas para una adecuada Gestión de los Riesgos Financieros. Así, se profundiza en temas como Medición del Riesgo Financiero, Enterprise Risk Management, Gestión del Riesgo Operacional, Crediticio, de Mercado y de Liquidez.

Destacados especialistas con experiencia en consultoría y el campo empresarial

Las clases son impartidas por expertos, reconocidos por su formación académica y una trayectoria forjada tanto en la investigación como en la gestión de las entidades más importantes del medio, lo que favorece la transmisión de conocimientos a partir de casos de actualidad.

Énfasis en la aplicación con los software utilizados en la práctica

El programa enfatiza el uso de software aplicados a los distintos riesgos financieros: Visual Basic, @risk y R, cosa que no hace ningún otro programa del mercado.

Certificación

Al culminar satisfactoriamente y aprobar el programa, el alumno obtendrá:

— **Certificado del Programa Especializado en Gestión del Riesgo Financiero**, otorgado por la Escuela de Postgrado de la UPC.



Perfil del ingresante

Profesionales que laboran en entidades financieras o que están interesados en trabajar en ellas, especialmente los que trabajan o buscan trabajar en áreas de riesgos financieros. Personas vinculadas a las áreas de Finanzas, Auditoría, Tesorería, Inversiones o relacionadas con actividades de consultoría o regulación.

Logro del egresado

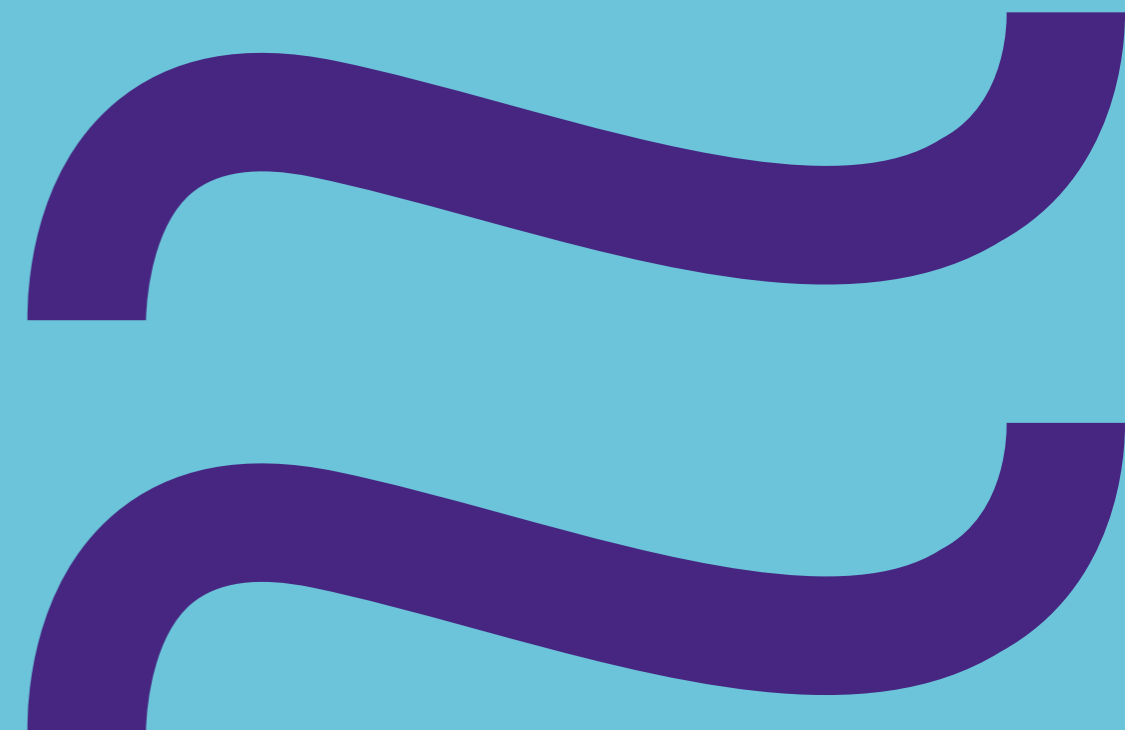
El participante tendrá una visión completa de los riesgos financieros, lo ayudará a diseñar de una manera más adecuada políticas de riesgos adecuadas para la institución que labora. Además, aprenderá a modelar los principales riesgos financieros utilizando distintos softwares de vanguardia utilizados actualmente en los mercados, y potenciará sus perfiles profesionales.

mallla curricular*

El Programa Especializado profundiza en tópicos como, *Enterprise Risk Management*, Gestión del Riesgo Operacional, Crediticio, de Mercado y Modelación del Riesgo con *Visual Basic*, *@Risk*, para que los participantes tengan una adecuada gestión del Riesgo Financiero.

*Todos los cursos presentados en la malla curricular son de carácter obligatorio. Siguiendo nuestro principio de actualización constante, la malla curricular está sujeta a modificaciones.

> CURSOS ESPECIALIZADOS	Fundamentos de la Medición del Riesgo Financiero	Estadística Avanzada para el Riesgo Financiero	<i>Enterprise Risk Management</i>
	Gestión del Riesgo de Mercado y Liquidez	Gestión del Riesgo Crediticio	Gestión del Riesgo Operacional
> MODELACIÓN	Modelación del Riesgo con <i>Visual Basic</i>	Modelación del Riesgo con <i>@risk</i>	Modelación del Riesgo con R



cursos del programa

01 Fundamentos de la medición del riesgo financiero

El curso permite que el participante actualice sus conocimientos en la medición del riesgo financiero. El riesgo, en forma de incertidumbre, se analiza según la información cuantitativa que se tiene disponible, verificada su calidad e idoneidad, tanto de manera descriptiva como inferencial.

Temario:

- Introducción al riesgo
- Estadística descriptiva
- Probabilidad y distribuciones de probabilidad
- Distribuciones muestrales y estimaciones de parámetros

03 Enterprise risk management

El curso permite comprender la naturaleza de los riesgos financieros en general y del *Enterprise Risk Management* en particular, analizando su impacto en las organizaciones en un entorno globalizado y profundamente cambiante, entendiendo sus aplicaciones y los detalles en su implementación en una empresa.

Temario:

- *Framework* del ERM
- Aplicaciones del ERM
- Implementación del ERM
- Casos de desastres corporativos

02 Estadística avanzada para el riesgo financiero

El curso presenta un conjunto de herramientas estadísticas y sus aplicaciones concretas a problemas de estimación, inferencia y predicción en la gestión del riesgo. Al concluir el curso el participante conocerá técnicas avanzadas cuantitativas que le ayudarán a gestionar, mitigar o transferir el riesgo.

Temario:

- Análisis de regresiones
- Modelos de series de tiempo
- Modelos heteroscedásticos
- Modelos de elección discreta y modelos censurados

04 Gestión del riesgo de mercado y liquidez

El curso explora el riesgo de mercado y de liquidez desde el punto de vista de la operatividad de una tesorería o una mesa de inversiones, analizando los diversos modelos existentes, así como también la valoración de productos, de tal manera que se tengan los elementos necesarios para medir, analizar y gestionar el riesgo de mercado y de liquidez de manera adecuada, de tal manera que podamos crear valor para el accionista.

Temario:

- Generalidades del riesgo de mercado. Introducción al *Value at Risk*
- VaR paramétrico. VaR Histórico. VaR Montecarlo. VaR Marginal. CVaR
- Riesgo de liquidez y financiación
- Valoración de productos financieros

05 Gestión del riesgo crediticio

El curso desarrolla conceptos teóricos y ejercicios prácticos con el fin de lograr una comprensión adecuada de los componentes de la gestión del riesgo de crédito así como de los parámetros para su medición precisa, de tal manera que logre entender los fundamentos de la modelación, a la vez de estar en la capacidad de establecer políticas de riesgos y procedimientos que permitan una administración adecuada de este riesgo.

Temario:

- Conceptos generales
- Parámetros del riesgo crediticio
- Modelamiento del riesgo crediticio
- Marco regulatorio del riesgo crediticio

07 Modelación del riesgo con *visual basic*

Los conocimientos adquiridos en los cursos anteriores tienen una aplicación práctica a través del desarrollo de diversos modelos de riesgos financieros a través del uso intensivo de las funciones estadísticas del *Microsoft Excel* y del *Visual Basic* (VBA).

Temario:

- Modelos de riesgos de mercado: *Value at Risk*
- Modelos de riesgo de crédito: *KMV Merton, Logit, Creditmetrics*

06 Gestión del riesgo operacional

El curso desarrolla el riesgo operacional en el marco de los acuerdos de Basilea y su aplicación en el Perú a través de técnicas y herramientas de medición y gestión, tanto bajo criterios básicos y avanzados, profundizando en los criterios para el registro de datos de pérdidas por riesgo operacional y analizando los criterios de reporte utilizados para bases de datos externas.

Temario:

- Naturaleza y causas del riesgo operacional
- Estructuras de gestión
- Medición y mitigación del riesgo operacional
- Aspectos regulatorios

08 Modelación del riesgo con *@risk*

El curso permite a los alumnos estar en la capacidad de aplicar la herramienta *@Risk* y *Microsoft Excel* para la correcta modelación y análisis de los riesgos financieros, produciendo información que será la base en el proceso de toma de decisiones.

Temario:

- Introducción al *@Risk*
- Medición del riesgo de mercado con *@Risk*
- Medición del riesgo crediticio con *@Risk*
- Medición del riesgo operacional con *@Risk*

cursos del programa

09 Modelación del riesgo con R

El estudiante elabora modelos de medición de riesgos de mercado, crédito y operacional mediante casos prácticos, utilizando el *software* estadístico R.

Temario:

- Introducción al R
- Medición del riesgo de mercado con R
- Medición del riesgo crediticio con R
- Medición del riesgo operacional con R



profesores de la UPC*

Las clases son impartidas por expertos, reconocidos por su formación académica y una trayectoria forjada tanto en la investigación como en la gestión de las entidades más importantes del medio.



Abel García
Director del Programa

Magíster en Finanzas por ESAN. Ingeniero Economista por la Universidad Nacional de Ingeniería. Ha sido Sub Gerente de Riesgos en Mercado, Metodología y Valoración en el BBVA Banco Continental. Actualmente es Gerente de Riesgos de Mercado en Prima AFP.



Víctor David

Maestro en Finanzas por la Universidad del Pacífico. Ha trabajado en el BBVA Perú y Panamá donde se desempeñó como Sub-Gerente de Riesgos Estructurales, de Liquidez y Fiduciarios. Actualmente, es Sub-Gerente de Riesgos en Mercados, Metodología y Valoración en el BBVA Continental.



Werner Haeberle

Diplomado en Marketing Integral por la Universidad Adolfo Ibáñez. Ingeniero Comercial por la Universidad del Pacífico, Chile. Ha sido Gerente General de la Cámara de Comercio de Lima, Gerente de Transformación y Productividad en el BBVA Banco Continental, donde actualmente es Gerente de Riesgos Estructurales, de Mercados y Fiduciarios.



Percy Paredes

Magíster en Finanzas por la Universidad del Pacífico. Ha sido Analista Senior Riesgos BPE en Interbank, Supervisor de Banca de Consumo en Mibanco y Jefe de Créditos Estratégicos en la Caja Municipal de Ica. Actualmente es Advisory Council Member en Gerson Lehman Group.



Vladimir Quevedo

MBA por HEC School of Management, Francia. Ha sido Jefe del Departamento de Administración de Encajes del Banco Central de Reserva del Perú. Actualmente es Jefe del Departamento de Programación del Circulante en el Banco Central de Reserva del Perú.



Renzo Ramos

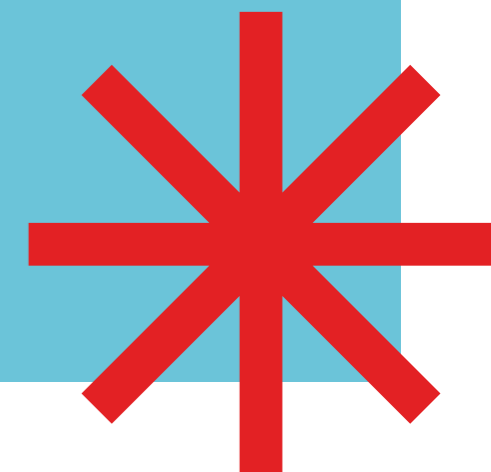
Maestría en Finanzas por ESAN. Ha sido Semi-Senior Auditor en Grant Thornton Perú, Auditor Asistente en Financiera ProEmpresa, Auditor Senior en Indecopi y Auditor Interno Senior en Interbank. Actualmente es Jefe de Auditoría Interna - SECRES en CESCE y docente de la Escuela de Postgrado de la UPC.



Manuel Tello

Master in Business Administration por Maastricht School of Management. Ha sido Enterprise Risk Manager en el BBVA Banco Continental. Actualmente es Jefe de Planeamiento de Riesgos en Entel.

* La escuela de postgrado de la UPC se reserva el derecho de hacer cambios en la plana de profesores.



WASC

Senior College and
University Commission

Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas is
accredited by the WASC Senior College and
University Commission (WSCUC), 985 Atlantic
Avenue, Suite 100, Alameda, CA 94501, 510.748.9001

Av. Cádiz 446 - 450
San Isidro
Lima 27 - Perú
T 511 419 2800
opción 3502
postgrado@upc.edu.pe

postgrado.upc.edu.pe

Duración:

9 meses

Plazo estimado.

Sujeto a variaciones de acuerdo
con el calendario de clases

