



**CENTRUM
PUCP**

**Executive
Education**
SAN ISIDRO

DIPLOMATURA INTERNACIONAL

Riesgo Financiero

DOBLE CERTIFICACIÓN
INTERNACIONAL



eada[®] business school
barcelona

Lifelong Learning

Executive Education Programs

Lifelong Learning

CENTRUM PUCP Business School Executive Education ofrece una amplia gama de programas de educación continua diseñados para las diferentes etapas de la vida profesional de nuestros participantes. Desde experiencias de aprendizaje modulares y cortas, hasta programas diseñados a medida y personalizados para empresas.

Nuestros programas cuentan con el respaldo de nuevos socios y alianzas educativas internacionales, compuestas por escuelas e instituciones de primer nivel como el Tecnológico de Monterrey (TEC), EADA Business School, LHH - DBM Perú, entre otros.

El objetivo principal es formar profesionales co-creadores de su propio conocimiento, con pensamiento integrador y mentalidad global con impacto positivo en su familia, organización y país.

CLARA ROSSELLÓ

Directora de Programas
Educación Ejecutiva

Acerca del Programa

Riesgo Financiero

La situación mundial, la correspondiente apertura que nuestra nuestra región enfrenta al día de hoy y la necesidad de contar con una visión global, hacen esencial una formación especializada de alto nivel con un componente de estudio internacional.

Según las exigencias del Acuerdo Basilea III, la gestión del riesgo operativo, de crédito y de mercado, son elementos fundamentales en el manejo financiero de una empresa. La Diplomatura de Estudio en Riesgo Financiero se ha creado para cubrir una necesidad insatisfecha de contar con profesionales especializados en el área de riesgos financieros.

Doble Certificación Internacional



CENTRUM PUCP



Diplomatura de Estudio Internacional Empresarial en Riesgo Financiero



EADA BUSINESS SCHOOL



Programa Avanzado Internacional en Riesgo Financiero



Objetivos

El cumplimiento de los objetivos que persigue el programa te permitirá:

- Identificar, evaluar y gestionar los riesgos en el área financiera de una empresa.
- Asignar de manera eficiente los recursos para el tratamiento del riesgo.
- Analizar y utilizar instrumentos de acuerdo a las normativas legales y reglamentarias exigidas.

Contenido del Programa

Riesgo Financiero

Módulo 1A

Finanzas Corporativas Aplicadas

El curso es de carácter teórico-práctico. Desarrolla los conceptos y herramientas que disponen quienes administran un área financiera para el logro de los objetivos empresariales en un ambiente con incertidumbre. Se analizarán los instrumentos financieros de acuerdo con los objetivos de creación de valor para los accionistas y los stakeholders.

Módulo 1B

Métodos Cuantitativos para la Medición de Riesgos

El curso es de carácter teórico-práctico. 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 posee un balance entre los fundamentos de teoría económica y, el uso de las técnicas y métodos desarrollados.

Módulo 1C

Gestión Integral del Riesgo

El curso es de carácter teórico-práctico. Busca analizar los fundamentos del riesgo, así como la definición e implementación del riesgo financiero en general. Se trata las implicancias de los acuerdos de Basilea III en el análisis del riesgo financiero. El riesgo, en forma de incertidumbre, se analizará según la información cuantitativa que tengamos disponible. Se tratan temas de previsión y gestión de riesgos, utilizando instrumentos financieros, así como, los riesgos y oportunidades de los negocios nacionales e internacionales, técnicas de medición, prevención y cobertura de riesgos.

Módulo 2A

Econometría para la Modelación del Riesgo

El curso es de carácter teórico-práctico. Busca alentar el desarrollo de nuevos métodos de inferencia basados en modelos conocidos como econometría financiera. La econometría financiera presenta las herramientas necesarias para analizar e interpretar los datos y poner a prueba muchos resultados teóricos que intentan explicar las características de las finanzas corporativas, valoración de activos, de inversiones y de las finanzas internacionales. Asimismo, la econometría financiera genera a su vez información de interés que requiere un mayor estudio teórico o empírico.

Módulo 2B

Gestión del Riesgo Operativo

El curso es de carácter teórico-práctico. Desarrolla el concepto de riesgo de operación en el marco de Basilea III (Nuevo Acuerdo de Capital) y su aplicación en el Perú a través de técnicas y herramientas de gestión. Asimismo, se profundiza en los criterios básicos para el registro de datos de pérdidas por riesgo operacional, analizando los criterios de reporte usados por consorcios internacionales para bases de datos externas. Se revisan los modelos de medición propios de los métodos avanzados.

Módulo 2C

Gestión del Riesgo de Mercado

El curso es de carácter teórico-práctico. Revisa los riesgos de mercado desde el punto de vista de la operatividad de tesorería, analizando también el papel del riesgo de crédito y las perspectivas del regulador. Se desarrollan elementos fundamentales para que los participantes puedan medir, analizar y gestionar los riesgos de mercado de manera adecuada.

Contenido del Programa

Riesgo Financiero

Módulo 3A

Gestión del Riesgo de Crédito

El curso es de carácter teórico-práctico. Analiza el riesgo de crédito de acuerdo a los estándares actuales, utilizando bases de razonamiento cuantitativas y cualitativas. Se desarrollan los criterios de gestión del riesgo de crédito, así como las herramientas de medición. El curso es práctico, permitiendo que los participantes desarrollen las capacidades para implementar sus propios modelos y medir su eficacia mediante las pruebas de validación y razonabilidad de modelos. Las aplicaciones teóricas abarcan conceptualmente algunos instrumentos financieros complejos como CDS, CDO, entre otros con el fin que los participantes comprendan su utilidad y riesgos potenciales.

Módulo 3B

Coberturas Financieras (EADA Business School)

El curso dictado por EADA Business School es de carácter teórico-práctico. Analiza los fenómenos importantes de los mercados financieros mundiales como son la desintermediación bancaria, la globalización y la tecnología de información han apoyado que las operaciones e instrumentos en este mercado sean los de mayor crecimiento en el campo de las finanzas. La perspectiva del curso es analizar las principales operaciones e instrumentos de este mercado bajo consideraciones de cobertura y especulación. El enfoque del curso será principalmente global con aplicaciones puntuales al mercado peruano.

Plana Docente

Riesgo Financiero

Henostroza Márquez, Patricia

Magíster en Administración Estratégica de Empresas en la Pontificia Universidad Católica del Perú, Especialista en Riesgos Financieros en la Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas, Licenciada en Administración en la Universidad Nacional Santiago Antúnez de Mayolo. En relación a su experiencia profesional, se ha desempeñado en áreas de riesgos y finanzas en empresas del sector financiero: analista de riesgos en Coface, analista de finanzas y responsable de portafolios en Refinancia Perú, analista de portafolios en Citibank Perú, Jefe de Riesgos Financieros en La Rehabilitadora, ha asesorado y capacitado a micro financieras en Gestión de Riesgos Financieros. Actualmente es Jefe de Riesgos Financieros en la empresa La Rehabilitadora Ltda. Profesora en el Área Académica de Finanzas, Contabilidad y Economía en CENTRUM PUCP Business School.

Rabanal Sobrino, Alejandro

El profesor Rabanal es Máster en Administración de Negocios, Duke University, EE.UU. Licenciado en Economía, Universidad del Pacífico, Perú. Certificación Financiera Risk Manager (FRM). En relación con su producción intelectual, es co-autor de los trabajos de investigación: Costo del Crédito en el Perú (Documento de Trabajo BCRP 2006) y Riesgo de Interconexión en el Sistema Financiero Peruano (Revista Moneda BCRP Nro. 148, 13-16).

En relación a su experiencia profesional, se desempeñó como Gerente de Riesgo de Crédito (2014-2017) y Gerente de Research Sell side Renta Fija y Renta Variable para Perú (2011-2014) en Credicorp Capital (banco de inversión de Credicorp) y Jefe del Área de Análisis del Mercado de Capitales y Regulación Financiera en el Banco Central de Reserva del Perú (1998-2011). Realizó una pasantía en el Banco Interamericano de Desarrollo (BID) en Washington DC. en el área del Sector Privado (2007). Cuenta con experiencia docente en la Universidad de Lima (pregrado y Centro Integral de Educación Continua) y en el Curso de Extensión de Finanzas del Banco Central de Reserva del Perú. Actualmente es Asesor de la Superintendencia del Mercado de Valores y Profesor en el Área Académica de Finanzas, Contabilidad y Economía en CENTRUM PUCP Business School.

Serrano Urdaneta, Angel

Magíster en Dirección Estratégica de Empresas (MBA) de la Pontificia Universidad Católica del Perú. Master Internacional en Liderazgo, Escuela de Alta Dirección y Administración (EADA), Barcelona – España. Ingeniero Electricista de la Universidad de Oriente, Anzoátegui – Venezuela.

En relación a su experiencia profesional, se desempeña como Gerente de negocios con experiencia internacional en la planeación estratégica, desarrollo y administración de empresas. Orientado al cumplimiento de objetivos y a la satisfacción de los clientes. Capacidades de liderazgo, formación y desarrollo de equipos de trabajo. Experiencia en diversos sectores industriales como Petróleo & Gas, Alimentos & Bebidas, Metales, Minería e Infraestructura. Actualmente es Gerente Central de Negocios de FAMETAL S.A, empresa peruana con más de 56 años en el mercado peruano, dedicada a la comercialización de productos eléctricos, electromecánicos, de instrumentación y control para la industria, así como también en el desarrollo e implementación de proyectos de infraestructura eléctrica y automatización de procesos industriales. En su calidad de docente se desempeña como Profesor tiempo parcial del área académica de Operaciones, Tecnología y Logística en CENTRUM PUCP Business School.

CENTRUM PUCP podrá efectuar cambios en la malla, secuencia de los cursos o profesores, de acuerdo a su política de mejora continua. De no cumplir con el quorum requerido, CENTRUM PUCP se reserva el derecho de postergar los inicios de los cursos y programas.

Plana Docente

Riesgo Financiero

Vásquez Reategui, Romy

La profesora Vásquez es Magister en Administración Estratégica de Empresas por CENTRUM PUCP Business School. Es Master en Liderazgo por EADA, Escuela de Alta Dirección y Administración de Barcelona, España. Es Ingeniera Industrial titulada de la Universidad Nacional Federico Villarreal. En relación a su experiencia profesional, se ha desempeñado como Gerente de Gestión del Portafolio Pyme en la División de Riesgos Banca Minorista del Banco de Crédito del Perú. Gerente Adjunto de Negociación y Recupero para el Área de Cobranzas Banca Minorista del Banco de Crédito del Perú. Sub Gerente de Riesgos Banca Mayorista en el Banco de Crédito del Perú. Cuenta con experiencia docente en la Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas, además de contar con experiencia en capacitaciones para el personal del Banco de Crédito del Perú (BCP) en diversas áreas a nivel nacional. En relación con su producción intelectual, es coautora del libro: Planeamiento Estratégico de la Industria de la Caña de Azúcar (Editorial: Centrum Católica, 2010). Actualmente es profesora en la Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas (UPC) en el Programa Académico EPE (Carreras Universitarias para Gente que Trabaja), siendo Profesora del Curso: Finanzas Aplicadas.

Zambrano Berendsohn, Mario Antonio

Master en Banca y Finanzas, Universidad Autónoma de Madrid, El España, 2002. Master en Economía, Georgetown University, Washington DC, USA, 1990-92. Bachiller en Economía, Pontificia Universidad Católica del Perú, 1987. Curso de Especialización en Gestión de Riesgos, New York University (NYU), USA, 1999. Superintendente Adjunto de Riesgos, Superintendencia del Mercados de Valores del Perú, diciembre 2013 a la fecha. Consultor Experto en Supervisión Financiera y Gestión de Riesgos, Fondo Monetario Internacional (FMI), desde 2011. Múltiples misiones a países. Ha participado en Múltiples auditorías y visitas de inspección en los últimos 20 años. Instructor de la Asociación de Supervisores Bancarios de las Américas (ASBA) y del Instituto Iberoamericano del Mercado de Valores (IIMV). Consultor Internacional en Gestión de Riesgos y Regulación Financiera. Profesor de cursos de Finanzas en Escuelas de Negocios, pregrado, postgrado, y programas de especialización. Autor de artículos de finanzas y supervisión basada en riesgos, a nivel nacional e internacional.

Chu Rubio, Jesus

El profesor Chu es Doctor en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad de Catalunya en España. Doctor en Ciencias Contables y Empresariales de la Universidad Nacional Mayor de San Marcos, Perú. Magíster en Administración de Empresas de la Universidad del Pacífico, Perú. Licenciado en Economía de la Universidad de Lima, Perú. En relación con su experiencia profesional, ha sido Director de las maestrías en Dirección en Negocios Internacionales y en Dirección en Administración y Finanzas de Escuela de Posgrado de la Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas EOI (España). Gerente de Operaciones de BellSouth (BAPCO) Yellow Pages. Gerente General de Valvoline INC (Perú). Director y Gerente General del Banco de Comercio. Gerente General Adjunto de Film S.A. y Gerente de Administración y Finanzas de la empresa Construcciones Metálicas Unión S.A. Cuenta con amplia experiencia en docencia a nivel posgrado, en la especialidad de Finanzas. Profesor invitado en Escuelas de Negocios de Costa Rica, Panamá, República Dominicana, Honduras y España. Consultor y Conferencista Internacional. Actualmente es Jefe y Profesor del Área Académica de Finanzas, Economía Empresarial y Contabilidad en CENTRUM PUCP Business School.

CENTRUM PUCP podrá efectuar cambios en la malla, secuencia de los cursos o profesores, de acuerdo a su política de mejora continua. De no cumplir con el quorum requerido, CENTRUM PUCP se reserva el derecho de postergar los inicios de los cursos y programas.

Admisión

Riesgo Financiero

Inversión regular

S/. 16,500

Financiamiento

- Al contado
- Financiamiento bancario
- Financiamiento CENTRUM
- Auspicio empresarial

Financiamiento CENTRUM PUCP

Te permite financiar el costo de tu programa con un interés de 0% y se aplica a personas naturales y jurídicas. Se expresa en letras de cumplimiento mensual. Para este beneficio, debes cumplir algunos requisitos y pasar una evaluación crediticia.

Auspicio Empresarial

También puedes financiar tu programa a través de una empresa. Esta empresa puede tener o no un convenio con nosotros. Consulta con tu asesor de capacitación para conocer las condiciones especiales de cada opción.

Requisitos para postular

Si cuentas con un año mínimo de experiencia en cargos ejecutivos o empresariales, puedes iniciar tu proceso de admisión enviando un correo electrónico a tu asesora de capacitación con los siguientes documentos:

- Ficha de Inscripción completa
- Copia simple del DNI (ambas caras), o Carné de extranjería o Pasaporte, en caso de postulantes extranjeros
- Currículum Vitae no documentado y foto escaneada (tamaño pasaporte, resolución no menor a 300 dpi, con saco y corbata, fondo blanco)

Condiciones

- Los precios y condiciones del programa están sujetos a variación
- El costo del programa incluye: Emisión del Certificado por parte de CENTRUM PUCP y EADA Business School
- El costo del programa no incluye: Emisión de certificados adicionales, constancias de notas, malla académica y participación, u otros

Duración

8 meses lectivos
Frecuencia Semanal

Horario

Martes y Viernes de 19:00 - 22:30
Sesiones ZOOM

Modalidad

Remota

(Hasta que se levanten las restricciones y podamos garantizar el bienestar de nuestros alumnos y profesores)

Lo que nos hace únicos

CENTRUM PUCP Business School

Calidad Educativa

Somos la única escuela de negocios del Perú que ha alcanzado la Triple Corona, una de las nueve de Latinoamérica y una de las 82 de las casi 13,670 escuelas de negocios en el mundo.

Excelencia Docente

Nuestros profesores se caracterizan por no solo llevar a las aulas lo mejor de su conocimiento teórico, sino también su experiencia profesional.

Compromiso Ético

Nuestra meta y el compromiso que asumimos para lograrla, son consistentes con nuestra principal responsabilidad: hacer de cada alumno el mejor profesional.

Procesos Certificados

Somos la única escuela de negocios con Cuádruple Certificación ISO, que garantiza la excelencia académica y demuestra nuestro compromiso con el medio ambiente y nuestra sociedad.

Liderazgo en Empleabilidad

La consultora Lee Hecht Harrison - DBM ayuda a nuestros alumnos a mejorar su empleabilidad y obtener beneficios en el campo laboral.

Oferta Laboral TOP

Más de 1000 ofertas laborales de empresas nacionales e internacionales a través de nuestra bolsa de trabajo exclusiva para nuestros alumnos y graduados.

Nuestros Rankings

Las mediciones de calidad en educación gerencial más serias y confiables del mundo ubican a nuestros programas en lugares preferenciales.

Somos la escuela de negocios líder en el Perú y una de las primeras en América Latina.

#1

Executive MBA
Perú

(Financial Times, 2019)

#90

Executive MBA
Worldwide

(Financial Times, 2019)

#2

Executive Education
Perú

(Financial Times, 2019)

#78

Executive Education
Worldwide

(Financial Times, 2019)



**FINANCIAL
TIMES**



**CENTRUM
PUCP**

**Executive
Education**
SAN ISIDRO

DIPLOMATURA
INTERNACIONAL

Riesgo Financiero



DOBLE CERTIFICACIÓN
INTERNACIONAL

“Nuestra propuesta educativa se basa en un modelo innovador y transformacional, formando líderes que piensan y actúan estratégica y globalmente, con sólidas capacidades gerenciales, y capaces de proporcionar valor a las organizaciones, bajo una perspectiva de innovación, responsabilidad social corporativa y sostenibilidad.”

Percy Marquina Feldman
Director General

Informes:

+51 959 179 180 | executive.centrum@pucp.edu.pe

centrum.pucp.edu.pe

TRIPLE CORONA



ACREDITACIONES INTERNACIONALES



5 PALMES OF
EXCELLENCE

eduniversal
2017 Best Business Schools Ranking



FINANCIAL
TIMES

EXECUTIVE EDUCATION

Nº **1** TOP **10**

en el Perú en Latinoamérica
Financial Times 2018