



RISK MANAGEMENT FUNDAMENTALS: GLOBAL VIEW

MARZO 2023



RiskMathics
FINANCIAL INSTITUTE

RISK MANAGEMENT FUNDAMENTALS: GLOBAL VIEW



LUIS SECO
DIRECTOR
SYGMA ANALYSIS

Luis Seco es Dr. por la Universidad de Princeton y actualmente es Profesor en el Departamento de Matemáticas de La Escuela de Administración de Rotman en la Universidad de Toronto; es Director de RiskLab, departamento que depende de la misma Universidad, dedicada a actividades de investigación y desarrollo en colaboración con compañías del medio financiero y otras organizaciones del ramo.

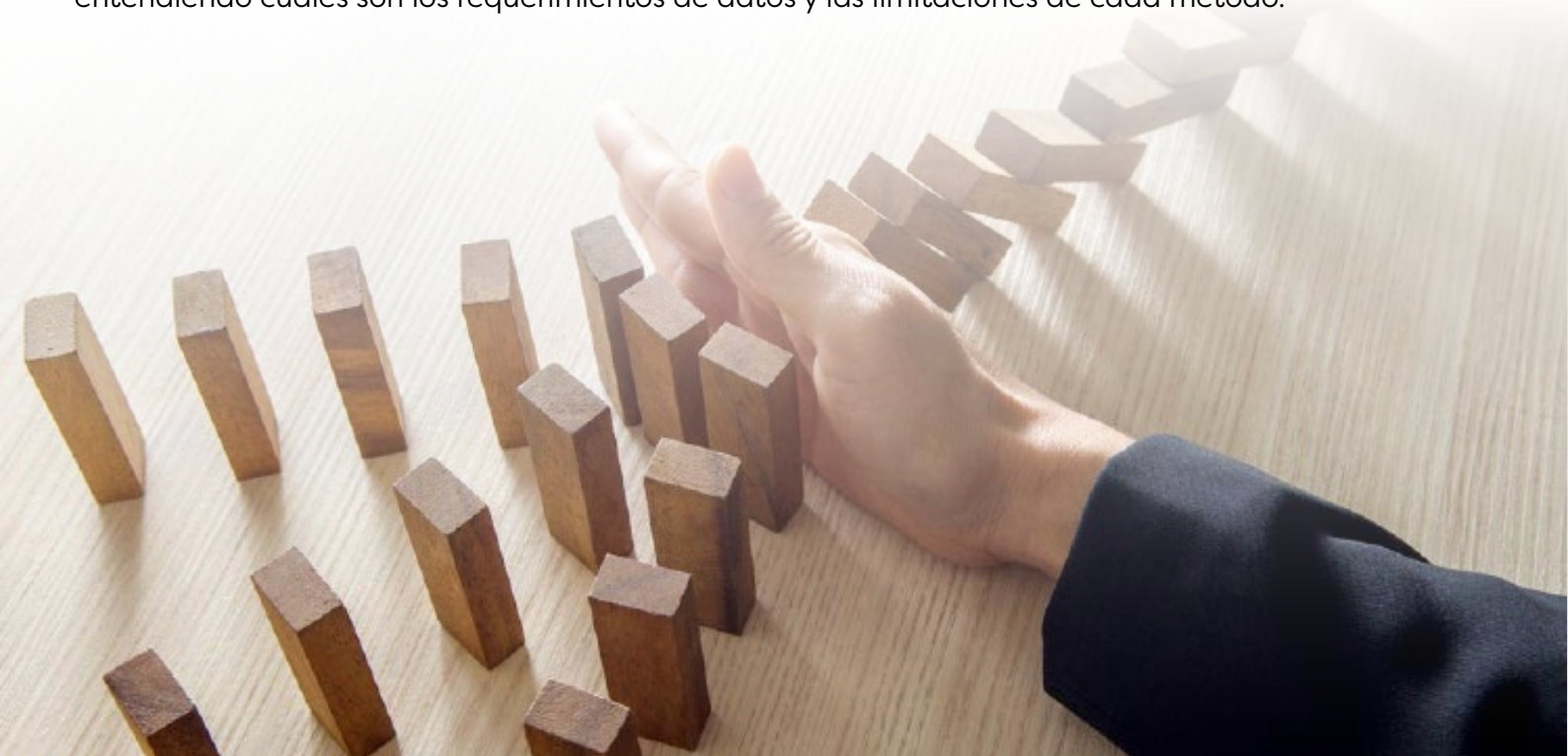
De igual manera el Dr. Seco es Presidente y Director general de Sigma Analysis & Management Ltd., firma especializada en inversiones en Hedge Funds y productos Estructurados. Asimismo, ha escrito numerosos artículos en distintas áreas de inversiones y dirección de riesgos. Actualmente ofrece conferencias y reuniones profesionales alrededor del mundo.

OBJETIVO:

Curso amplio e integral en administración de riesgos financieros, que cubre las diferentes perspectivas sobre riesgo financiero por subsector, geografía y tipo de riesgo. Se enfoca tanto en la perspectiva regulatoria como en el ángulo de implementación, brindando a los participantes una visión de 360 grados sobre el pasado, el presente y el futuro, la implementación, el marco legal y los impulsores de la evolución futura.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE:

Los participantes lograrán una visión global de la administración de riesgos, entendiendo cómo ha evolucionado en las diferentes jurisdicciones a lo largo de la historia y cómo se enfoca el riesgo en las diferentes áreas del sector financiero, especialmente en las ramas de banca, seguros y gestión de activos. Los alumnos aprenderán cómo las diferentes metodologías fueron concebidas e implementadas, entendiendo cuáles son los requerimientos de datos y las limitaciones de cada método.



PERFIL DEL PARTICIPANTE Y REQUISITOS:

Conocimientos de finanzas básicas, matemáticas y estadística, excel y programación básica. No es necesario tener conocimientos avanzados sobre ninguno de estos temas.

TEMARIO:

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

MARZO 2023

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	

