

FINANZAS

Administración del riesgo

	UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO FACULTAD DE CONTADURÍA Y ADMINISTRACIÓN PLAN DE ESTUDIOS DE LA LICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓN Sistema Escolarizado: Modalidad Presencial Programa de Estudios de la asignatura		
Administración del riesgo			
Clave	Semestre	Créditos	Campo de conocimiento: Finanzas
	7° - 8°	8	Eje de formación: Profesionalización
Modalidad	Curso (<input checked="" type="checkbox"/>) Taller () Lab () Seminario () Otros (especificar)		Tipo T (<input checked="" type="checkbox"/>) P () T/P ()
Carácter	Obligatorio () Optativo (<input checked="" type="checkbox"/>) Obligatorio E () Optativo E ()		Horas
Duración (Número de semanas)	16		Semana Semestre
			Teóricas: 4 Teóricas: 64
			Prácticas: 0 Prácticas: 0
			Total 4 Total 64
Seriación			
Ninguna ()			
Obligatoria ()			
Asignatura antecedente			
Asignatura subsecuente			
Indicativa (<input checked="" type="checkbox"/>)			
Asignatura antecedente	Finanzas corporativas		
Asignatura subsecuente	Ninguna		
Objetivo general:			
Al finalizar el curso, el alumnado determinará las técnicas de medición y control de riesgos, a partir de identificar los mismos.			

Objetivos particulares:

Al finalizar la unidad, el alumnado:

1. Comprenderá la importancia y contenido de la administración de riesgos.
2. Evaluará el riesgo de mercado.
3. Analizará el riesgo de crédito.
4. Comprenderá el riesgo operativo y otros tipos de riesgos.

Índice temático			
Unidad	Tema	Horas Semestre	
		Teóricas	Prácticas
1	Importancia y contenido de la administración de riesgos	6	0
2	Riesgo de mercado	24	0
3	Riesgo de crédito	20	0
4	Riesgo operativo y otros tipos de riesgos	14	0
Total		64	

Contenidos temáticos	
Subtemas	
Temas	1. Importancia y contenido de la administración de riesgos
1	1.1. Significado de la administración de riesgos 1.2. Proceso de administración de riesgos 1.3. Identificación de riesgos 1.4. Comité de Basilea y la normatividad de la administración de riesgos 1.5. Administración de riesgos y sus herramientas 1.6. Supervisión y auditoría de riesgos
	2. Riesgo de mercado
2	2.1. Significado e importancia 2.2. Factores de riesgo de mercado 2.3. Normatividad 2.4. Cuantificación del riesgo de mercado 2.5. Valor en riesgo (VaR) 2.6. Concepto y supuestos 2.7. Metodologías 2.8. Modelación y predicción 2.9. VaR paramétrico 2.10. VaR diversificado 2.11. Back-Testing y Stress Testing 2.12. Simulación de Montecarlo

	3. Riesgo de crédito
3	3.1. Concepto y componentes 3.2 Factores de riesgo 3.3. Normatividad 3.4. Metodologías y modelos para la cuantificación del riesgo de crédito 3.5. Modelo de CreditMetrics 3.6. Modelos estadísticos y otros modelos
	4. Riesgo operativo y otros tipos de riesgos
4	4.1. Concepto y factores de riesgo 4.2. Modelos para la cuantificación del riesgo operativo 4.3. Sistemas de administración del riesgo operativo 4.4. Riesgo de liquidez y administración de activos y pasivos (ALM) 4.5. Riesgo legal 4.6. Riesgo tecnológico

Estrategias didácticas	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ Exposición ◦ Trabajo en equipo ◦ Lecturas ◦ Trabajo de investigación ◦ Aprendizaje basado en problemas ◦ Casos de enseñanza ◦ Mapas mentales ◦ Mapas conceptuales ◦ Cuadros sinópticos

Evaluación del aprendizaje	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ Exámenes parciales ◦ Examen final ◦ Trabajos y tareas ◦ Participación en clase ◦ Presentación de tema ◦ Rúbricas ◦ Lista de cotejo ◦ Portafolios
Perfil profesiográfico del docente	
Título o grado	Licenciatura en Administración o afín. Preferentemente con estudios de posgrado en el área de Finanzas.
Experiencia docente	Mínima deseable de 2 años, a nivel licenciatura en las áreas Económico-Administrativas.
Otras características	Experiencia profesional mínima de tres años en el área de conocimiento y en el Sistema Financiero Mexicano. Conocimientos a nivel de comprensión del idioma inglés y en el manejo de sistemas de cómputo.

	<p>Compartir, respetar y fomentar los valores fundamentales que orientan a la Universidad Nacional Autónoma de México.</p> <p>Para profesores(as) de nuevo ingreso:</p> <p>Haber aprobado el “Curso Fundamental para profesores de Nuevo Ingreso (Didáctica Básica)” que imparte la Facultad de Contaduría y Administración, así como cubrir satisfactoriamente los requisitos impuestos por el departamento de selección y reclutamiento de la Facultad de Contaduría y Administración.</p> <p>Para profesores(as) que ya imparten clases en la Facultad:</p> <p>Haber participado recientemente en cursos de actualización docente y de actualización disciplinar con un mínimo de 20 horas.</p>
--	--

Bibliografía básica	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ De Lara, H. & A. (2007) <i>Medición y Control de Riesgos Financieros</i> (3ª. ed.) México, Limusa. ◦ Hull, J. (2014) <i>Risk Management and Financial Institutions</i>, (4a. ed.) Estados Unidos. Prentice Hall.
Mesografía (referencias electrónicas)	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ Banco de México. (2020). http://www.banxico.org.mx ◦ Comisión Nacional Bancaria y de Valores (2020). http://www.cnbv.gob.mx ◦ Grupo Bolsa Mexicana de Valores. (2020). https://www.bmv.com.mx

Bibliografía complementaria	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ Crouhy, G. M. (2000) <i>Risk Management</i> (1era. ed.) México, McGraw-Hill, ◦ Jorion, P. (2003) <i>Valor en Riesgo</i> (1era. ed.) México, Limusa. ◦ Venegas, F. (2006) <i>Riesgos Financieros y Económicos</i>, (2ª. ed.) México, CENGAGE Learning. ◦ Uyemura, D. D. (1993) <i>Risk Management in Banking</i> (1era. ed.) México, Mc Graw Hill.
Mesografía (referencias electrónicas)	
	<ul style="list-style-type: none"> ◦ Bolsa Institucional de Valores (2021) https://www.biva.mx ◦ Harvard Business Publishing Education, (2021) https://hbsp.harvard.edu/cases/