

PROGRAMA DE LA ASIGNATURA.

NOMBRE: ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO		CLAVE: 1039
PLAN: 2005		CRÉDITOS: 8
LICENCIATURA:		SEMESTRE:
AREA: FINANZAS		HORAS POR CLASE: 2
REQUISITOS:		HORAS POR SEMANA: 4
TIPO DE ASIGNATURA:	OBLIGATORIA ()	OPTATIVA (X)

OBJETIVO GENERAL DEL CURSO:

EL ALUMNO SERÁ CAPAZ DE APLICAR LAS TÉCNICAS DE MEDICIÓN Y CONTROL DE RIESGOS, A PARTIR DE IDENTIFICAR LOS MISMOS

TEMAS:	HORAS SUGERIDAS:
I. IMPORTANCIA Y CONTENIDO DE LA ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS	4 Hrs.
II. RIESGO DE MERCADO	30 Hrs
III. RIESGO DE CRÉDITO	20 Hrs.
IV. RIESGO OPERATIVO Y OTROS TIPOS DE RIESGOS	14 Hrs.
TOTAL	68 Hrs.

I. IMPORTANCIA Y CONTENIDO DE LA ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS

1. Significado de la administración de riesgos
2. Proceso de administración de riesgos
3. Identificación de riesgos
4. Comité de Basilea y la normatividad de la administración de riesgos
5. Repaso de matemáticas para la administración de riesgos
6. Administración de riesgos y sus herramientas
7. Supervisión y auditoría de riesgos

II. RIESGO DE MERCADO

1. Significado e importancia
2. Factores de riesgo de mercado
3. Normatividad
4. Cuantificación del riesgo de mercado
5. Valor en riesgo (VaR)
6. Concepto y supuestos
7. Metodologías
8. Modelación y predicción
9. VaR paramétrico
10. VaR diversificado
11. Back-Testing y Stress Testing
12. Simulación de Montecarlo

III. RIESGO DE CRÉDITO

1. Concepto y componentes
2. Factores de riesgo
3. Normatividad
4. Metodologías y modelos para la cuantificación del riesgo de crédito
5. Modelo de CreditMetrics
6. Modelos estadísticos y otros modelos

IV. RIESGO OPERATIVO Y OTROS TIPOS DE RIESGOS

1. Concepto y factores de riesgo
2. Modelos para la cuantificación del riesgo operativo
3. Sistemas de administración del riesgo operativo
4. Riesgo de liquidez y administración de activos y pasivos (ALM)
5. Riesgo legal
6. Riesgo tecnológico

BIBLIOGRAFÍA BASICA:

HULL, John, *Risk Management and Financial Institutions*, 2007, Prentice Hall

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA:

1. DE LARA Haro, Alfonso, *Medición y Control de Riesgos Financieros*, 3ª edición, 2007, Limusa
2. JORION Philipe, *Valor en Riesgo*, 2003, Limusa
3. CROUHY, Galai, Mark, *Risk Management*, McGraw-Hill, 2000
4. VENEGAS, Francisco, *Riesgos Financieros y Económicos*, 2006, CENGAGE
5. UYEMURA D, Van Deventer, *Risk Management in Banking*, 1993, Mc Graw Hill

TÉCNICAS DE ENSEÑANZA SUGERIDAS:

Exposición oral (x)
Exposición audiovisual (x)
Ejercicios dentro de clase (x)
Seminarios ()
Lecturas obligatorias (x)
Trabajos de investigación(x)
Prácticas de taller o laboratorio(x)
Prácticas de campo ()
Otras ()

ELEMENTOS DE EVALUACIÓN

Exámenes parciales(x)
Exámenes finales(x)
Trabajos y tareas fuera del aula(x)
Participación en clase(x)
Asistencia a prácticas()
Otras()

PERFIL PROFESIOGRÁFICO DEL DOCENTE

ESTUDIOS ACADÉMICOS:

Tener la Licenciatura en Contaduría, Licenciatura afín o con Maestría o Doctorado en Finanzas.
Tener conocimientos a nivel de comprensión del idioma inglés.
Tener conocimientos en el manejo de sistemas de cómputo y paquetería especializada de Finanzas.

EXPERIENCIA PROFESIONAL DESEABLE:

Tener experiencia en el área de derivados por espacio de tres años como mínimo
Conocer las asignaturas de: Finanzas I a Finanzas VII para la Licenciatura en Contaduría.

OTROS REQUERIMIENTOS:

Acreditar los cursos de didáctica de 30 horas en la Secretaria de Planeación Académica de la Facultad de Contaduría y Administración.