



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO  
 FACULTAD DE CONTADURÍA Y ADMINISTRACIÓN  
 PLAN DE ESTUDIOS DE LA LICENCIATURA EN  
 ADMINISTRACIÓN  
 Programa de la asignatura



Administración del Riesgo

|   |                                  |  |                         |                           |
|---|----------------------------------|--|-------------------------|---------------------------|
| <b>Clave:</b>   | <b>Semestre:</b><br>Entre 5° y 8 | <b>Área o campo de conocimiento:</b><br>Finanzas |                         | <b>No. Créditos:</b><br>8 |
| <b>Carácter:</b> Optativa de elección profesionalizante |                                  | <b>Horas</b>                                     | <b>Horas por semana</b> | <b>Horas al semestre</b>  |
| <b>Tipo:</b> Teórica                                    |                                  | <b>Teoría:</b>                                   | <b>Práctica:</b>        | 64                        |
|   |                                  | 4  | 0                       |                           |
| <b>Modalidad:</b> Curso                                 |                                  | <b>Duración del programa:</b> Semestral          |                         |                           |

**Seriación:** Si ( ) No ( x ) Obligatoria ( ) Indicativa ( )

Asignatura antecedente: Ninguna

Asignatura subsecuente: Ninguna

**Objetivo general del curso:**

El alumno será capaz de valorar productos financieros derivados, así como evaluar estrategias empleando los mismos.

**Índice Temático**

| Unidad                 | Tema  | Horas    |           |
|------------------------|---|----------|-----------|
|                        |   | Teóricas | Prácticas |
| I                      | Importancia y contenido de la administración de riesgos | 4        | 0         |
| II                     | Riesgo de mercado                                       | 26       | 0         |
| III                    | Riesgo de crédito                                       | 20       | 0         |
| IV                     | Riesgo operativo y otros tipos de riesgos               | 14       | 0         |
| <b>Total de horas:</b> |   | 64       |           |

**Bibliografía básica:**

1. CROUHY, Galai, Mark, *Risk Management*, McGraw-Hill, 2000, 717 pp.
2. DE LARA Haro, Alfonso, *Medición y Control de Riesgos Financieros*, 3ª edición, 2007, Limusa, 219 pp.
3. HULL, John, *Risk Management and Financial Institutions*, 2007, Prentice Hall , 556 pp.
4. JORION Philipe, *Valor en Riesgo*, 2003, Limusa, 357 pp.
5. VENEGAS, Francisco, *Riesgos Financieros y Económicos*, 2006, CENGAGE, 1139 pp.

**Bibliografía complementaria:**

1. DE LARA Haro Alfonso, *Medición y Control de Riesgos Financieros*, 3ª edición, Ed. Limusa, México, 2003, 219 pp.

2. TITMAN Sheridan , *Valoración*,. Ed. Pearson., México, 2009, 552 pp  
 3. UYEMURA D, Van Deventer, *Risk Management in Banking*, 1993, Mc Graw Hill 361 pp.

| <b>Sugerencias didácticas:</b>        | <b>Mecanismos de evaluación del aprendizaje de los alumnos:</b> |
|---------------------------------------|---|
| Exposición oral ( x )                 | Exámenes parciales ( x )  |
| Exposición audiovisual ( x )          | Examen final escrito ( x )                                      |
| Ejercicios dentro de clase ( x )      | Trabajos y tareas fuera del aula ( x )                          |
| Ejercicios fuera del aula ( x )       | Exposición de seminarios por los alumnos ( )                    |
| Seminarios ( )                        | Participación en clase ( x )                                    |
| Lecturas obligatorias ( x )           | Asistencia ( )  |
| Trabajo de investigación ( x )        | Seminario ( )   |
| Prácticas de taller o laboratorio ( ) | Otras: ( )  |
| Prácticas de campo ( )                |   |
| Otras: _____ ( )                      |   |

**Perfil profesiográfico:**

Estudios requeridos:  
 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.

Experiencia docente: Dos años o más a nivel preparatoria o licenciatura