



## 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		
<b>Administración del riesgo</b>			
<b>Clave</b>	<b>Semestre</b>	<b>Créditos</b>	<b>Campo de conocimiento:</b> Finanzas
	7° - 8°	8	<b>Eje de formación:</b> Profesionalización
<b>Modalidad</b>	Curso ( X ) Taller ( ) Lab ( ) Seminario ( ) Otros (especificar)	<b>Tipo</b>	T ( X ) P ( ) T/P ( )
<b>Carácter</b>	Obligatorio ( ) Optativo ( X ) Obligatorio E ( ) Optativo E ( )	<b>Horas</b>	
<b>Duración</b> (Número de semanas)	16	<b>Semana</b>	<b>Semestre</b>
		Teóricas: 4	Teóricas: 64
		Prácticas: 0	Prácticas: 0
		Total 4	Total 64
<b>Seriación</b>			
Ninguna ( )			
Obligatoria ( )			
<b>Asignatura antecedente</b>			
<b>Asignatura subsecuente</b>			
<b>Indicativa ( X )</b>			
<b>Asignatura antecedente</b>	Finanzas corporativas		
<b>Asignatura subsecuente</b>	Ninguna		
<b>Objetivo general:</b>			
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.

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

<b>Contenidos temáticos</b>	
<b>Subtemas</b>	
<b>Temas</b>	<b>1. Importancia y contenido de la administración de riesgos</b>
<b>1</b>	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
	<b>2. Riesgo de mercado</b>
<b>2</b>	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

	<b>3. Riesgo de crédito</b>
<b>3</b>	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
	<b>4. Riesgo operativo y otros tipos de riesgos</b>
<b>4</b>	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

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

<b>Evaluación del aprendizaje</b>	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>◦ Exámenes parciales</li> <li>◦ Examen final</li> <li>◦ Trabajos y tareas</li> <li>◦ Participación en clase</li> <li>◦ Presentación de tema</li> <li>◦ Rúbricas</li> <li>◦ Lista de cotejo</li> <li>◦ Portafolios</li> </ul>

<b>Perfil profesiográfico del docente</b>	
<b>Título o grado</b>	Licenciatura en Administración o afín. Preferentemente con estudios de posgrado en el área de Finanzas.
<b>Experiencia docente</b>	Mínima deseable de 2 años, a nivel licenciatura en las áreas Económico-Administrativas.
<b>Otras características</b>	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>
--	--

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

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