

Administración del Riesgo

Área de especialización: Finanzas	Clave: CP467
-----------------------------------	--------------

Objetivo general de la asignatura

Al finalizar el curso, el alumno:

Evaluará la pertinencia de los diferentes modelos que permitan administrar el riesgo financiero que enfrentan las organizaciones a partir del análisis y aplicación de sus elementos particulares para la adecuada toma de decisiones de inversión.

Temas y subtemas

1 Introducción a la administración de riesgos

1.1 Tendencias generales de la macroeconomía actual

1.2 Fuentes que originan los riesgos y la volatilidad en los mercados reales y financieros

1.3 Tipos de riesgos

2 Regulación financiera

2.1 La Comisión Nacional Bancaria y de Valores y Banco de México

2.2 Comité de Supervisión Bancaria del BIS y Acuerdos de Basilea

3 Riesgos de mercado

3.1 Definición y aproximaciones para la mitigación de riesgos de mercado

3.2 Productos financieros derivados

3.3 Riesgos de tasas de interés: Duración y convexidad

3.4 Teoría estadística

3.5 Valor en riesgo (VAR)

4 Riesgos de crédito

4.1 Definición de riesgos de crédito

4.2 Modelos para estimar el riesgo de crédito

4.3 Calificadoras de riesgos

5 Riesgo de liquidez

5.1 Definición de riesgo de liquidez

5.2 Modelos para estimar el riesgo de liquidez

5.3 Otras aproximaciones: riesgo de liquidez de mercado

6 Riesgo operacional

6.1 Definición de riesgo operacional

6.2 método de indicador básico, método estándar, y método de medición avanzado

6.3 Documentos de trabajo con relación a los riesgos operacionales