

Programa de estudios de la asignatura

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