



**UNIVERSIDAD DE GUADALAJARA**  
**CENTRO UNIVERSITARIO DE CIENCIAS ECONÓMICO ADMINISTRATIVAS**  
SECRETARÍA ACADÉMICA/COORDINACIÓN DE POSGRADO

**MAESTRÍA EN FINANZAS**

**Datos Generales**

|                                     |           |                       |                           |
|-------------------------------------|-----------|-----------------------|---------------------------|
| 1. Nombre de la Asignatura          |           | 2. Nivel de formación | 3. Clave de la Asignatura |
| Administración de Riesgos           |           | Maestría              | IF930                     |
| 4. Prerrequisitos                   |           | 5. Área de Formación  | 6. Departamento           |
| Ninguno                             |           | Optativa abierta      | Finanzas                  |
| 7. Modalidad                        |           | 8. Tipo de Asignatura |                           |
| Presencial / Presencial enriquecido |           | Curso - Taller        |                           |
| 9. Carga Horaria                    |           |                       |                           |
| Horas BCA                           | Horas AMI | Horas Totales         | Créditos                  |
| 48 Hrs.                             | 64 Hrs.   | 112 Hrs.              | 7                         |

**Contenido del Programa**

10. Presentación

Por su naturaleza, se plantea parte conceptual y parte pragmática.

El curso ha sido concebido como una herramienta que le proporcione al alumno de posgrado, elementos de reflexión y visualización de una actividad profesional en la cual se debe de generar concepto y estilo propios.

Se abordan conceptos relacionados con el riesgo, normas, procedimientos y técnicas para la medición y gestión de los mismos

11.- Objetivos del programa

## Objetivo General

Comprender la importancia de la administración de riesgos y aplicar normas, procedimientos y técnicas de la misma en la identificación, medición y gestión de riesgos financieros en las unidades de negocio y/o portafolios de instrumentos financieros

## 12.-Contenido

### Contenido temático

Unidad 1 Introducción a la administración de riesgos

Unidad II Riesgo de Mercado

Unidad III VAR

Unidad IV Riesgo de crédito

### Contenido desarrollado

#### **Unidad 1 Introducción a la administración de riesgos**

1. Conceptos, generalidades y definiciones
2. Importancia de la administración de riesgos
3. Áreas de impacto de la administración de riesgos
4. El riesgo y su relación con las finanzas conductuales
5. Rendimiento esperado
6. Desviación Estándar
7. Covarianza
8. Correlación

#### **Unidad II Riesgo de Mercado**

9. Conceptos, generalidades y definiciones
10. Tipos de riesgo de mercado
11. Impacto del riesgo de mercado
12. Medición de riesgo de mercado

- 13. Minimización del riesgo de mercado a través del uso de instrumentos financieros
- 14. Diversificación

### **Unidad III Var**

- 15. Conceptos, generalidades y definiciones
- 16. Elementos a considerar dentro del VAR
- 17. Cálculo e interpretación de VAR
- 18. Pronósticos de volatilidad y correlaciones

### **Unidad IV Riesgo de crédito**

- 19. Conceptos, generalidades y definiciones
- 20. Cálculo de riesgo de crédito
- 21. Relación del riesgo de crédito y las tasas de interés

### 13. Actividades Prácticas

Se sugiere el uso de casos de estudio, simuladores, software y cualquier otra actividad que permita poner en práctica todo lo revisado en la teoría a lo largo del curso.

### 14.- Evaluación

Se sugiere que la evaluación del curso se dé a través de los siguientes indicadores, siempre y cuando los mismos se adapten a lo requerido en el curso y a consideración del profesor.

- 1) Exámenes
- 2) Trabajos de investigación
- 3) Exposiciones
- 4) Tareas
- 5) Participación
- 6) Casos de estudio

## 7) Simuladores

### 15.- Bibliografía

Hull, J. (2007). *Risk management and financial Institutions*. Pearson Prentice Hall.

Sanchez, C. (2001). *Valor en riesgo*. Algorithmics Mexico.

Venegas , F. (2006). *Riesgos Financieros y económicos*. Thompson.

Wilmott, P. (2005). *Quantitative Finance*. Wiley.

### Otros materiales

Computadora, Cañon, Conexión a internet y todo aquel material que el profesor considere adecuado para cumplir con el objetivo del curso.

### 16.- Perfil del profesor

-Preferente con licenciatura en el ámbito económico administrativo deseable en administración financiera o finanzas, actuaría, matemáticas, maestría en el ámbito económico administrativo deseable en finanzas o economía, matemáticas, actuaría, con experiencia profesional en el medio financiero, instituciones públicas o privadas con deseable participación en trabajos de investigación tanto nacionales como internacionales.