UNIVERSIDAD DEL AZUAY

FACULTAD DE CIENCIAS DE LA ADMINISTRACIÓN
ESCUELA DE ECONOMÍA EMPRESARIAL

1. Datos generales

Materia: GESTIÓN DE RIESGOS PARA ECE
Código: FAD0117
Paralelo: A
Periodo : Septiembre-2019 a Febrero-2020
Profesor: PINOS LUZURIAGA LUIS GABRIEL
Correo electrónico: lpinos@uazuay.edu.ec

Nivel: 9

Distribución de horas.

Docencia	Práctico	Autónomo: 0		Total horas
		Sistemas de tutorías	Autónomo	
4				4

Prerrequisitos:

Código: FAD0115 Materia: EVALUACIÓN DE INVERSIONES

2. Descripción y objetivos de la materia

En el capítulo primero, se abordará teóricamente el tema de la administración estratégica y su aplicación práctica en las empresas de la región y el país. En los capítulos segundo y tercero, se realizará un acercamiento teórico sobre lo que es el riesgo empresarial, sus tipos, indicadores y modelación. Finalmente, los capítulos cuarto y quinto, están dedicados al riesgo financiero y a su tratamiento corporativo a través del manejo de instrumentos de gestión de riesgos.

El análisis y la administración de riesgos en la empresa es de vital importancia para la toma de decisiones gerenciales, la gerencia de riesgos y el acertado manejo de la información económica del entorno global, nacional y local es un requisito indispensable para quienes dirigen las empresas. La Gestión de Riesgos contribuye a la formación del profesional como herramienta gerencial básica.

La asignatura de Gestión de Riesgos se relaciona directamente con la Evaluación de Inversiones, las Finanzas, la Matemática Aplicada y la Estadística.

3. Objetivos de Desarrollo Sostenible

4. Contenidos

1.1	Antecedentes y conceptos
1.2	Administración de Riesgos
1.3	Desastres financieros en ausencia de administración de riesgos
1.4	Análisis de Riesgo en el contexto de Basilea
1.5	Normativa Referente a Riesgos financieros en Ecuador.
2.1	Precio de un activo y su rendimiento como Variable aleatoria
2.2	Rendimiento simple y logaritmico
2.3	Espacio Riesgo / Rendimiento esperado
2.4	Cartera de riesgo para dos o mas activos
2.5	Riesgo, cavarianza y correlación
3.1	Series de Tiempo y sus componentes

3.2	Volatilidad Histórica
3.3	Métodos de Suavizamiento para pronóstico
3.4	Metodos que evaluan la precisión del pronóstico
3.5	Modelos Estacionarios y no estacionarios
4.1	Valor en Riesgo Paramétrico
4.2	Valor en Riesgo No paramétrico
5.1	Normativa referente a riesgo de Crédito en Ecuador
5.2	Pérdida esperada y no esperada
5.3	Calculo de La probabilidad de incumplimiento
5.4	Cálculo de la Pérdida dada el incumplimiento
5.5	Calculo de Exposición
6.1	Normativa referente a riesgo de mercado y liquidez
6.2	Tasa de interes y su estructura
6.3	Tasa de interes forward
6.4	Duración y Convexidad
6.5	Var para un instrumento de deuda
6.6	Análisis de GAP o brecha de liquidez

5. Sistema de Evaluación

Resultado de aprendizaje de la carrera relacionados con la materia

Resultado de aprendizaje de la materia	Evidencias
ax. Conocer los mecanismos de financiación de la Empresa.	
-Establece la situación económica, financiera y de riesgo actual de la empresa, técnicamente	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
-Establece las fuentes de financiamiento que ofrece el mercado y estima el riesgo de crédito, liquidez y operativo, con honestidad	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
ay. Generar e interpretar los balances contables y los indicadores económicos de la empresa.	
-Conoce los indicadores económicos y financieros de la empresa.	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
-Construye e interpretar los indicadores económicos y financieros de la empresa con honestidad.	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
ba. Dar seguimiento al mercado financiero local, nacional y global.	
-Aplica técnicas de análisis para medición de riesgo de mercado de derivados, tasa de interés y descalce de plazos	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
-Evalúa la información de los mercados financieros con objetividad	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
bb. Pronosticar el comportamiento macro y microeconómico y su influencia en la toma de decisiones de las organizaciones económicas públicas y privadas.	
-Aplica los modelos de probabilidad bajo el enfoque del riesgo	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
-Evalúa los instrumentos para la gestión de riesgos con ecuanimidad	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos

Desglose de evaluación

Evidencia	Descripción	Contenidos sílabo a evaluar	Aporte	Calificación	Semana
Evaluación escrita	prueba escrita	ANÁLISIS Y GESTIÓN DEL RIESGO, RIESGO Y RENDIMIENTO, VOLATILIDAD	APORTE	8	Semana: 4 (30-SEP-19 al 05-OCT-19)
Trabajos prácticos - productos	presentación de trabajos	ANÁLISIS Y GESTIÓN DEL RIESGO, RIESGO Y RENDIMIENTO, VOLATILIDAD	APORTE	2	Semana: 4 (30-SEP-19 al 05-OCT-19)
Evaluación escrita	prueba escrita	RIESGO DE CREDITO, VAR PARAMÉTRICO Y NO PARAMÉTRICO	APORTE	8	Semana: 9 (05-NOV-19 al 09-NOV-19)
Trabajos prácticos - productos	trabajo escrito	RIESGO DE CREDITO, VAR PARAMÉTRICO Y NO PARAMÉTRICO	APORTE	2	Semana: 9 (05-NOV-19 al 09-NOV-19)
Trabajos prácticos - productos	presentación de ejercicios	RIESGO DE MERCADO Y LIQUIDEZ, RIESGO OPERATIVO	APORTE	2	Semana: 13 (02-DIC-19 al 07-DIC-19)
Evaluación escrita	prueba escrita	RIESGO DE MERCADO Y LIQUIDEZ, RIESGO OPERATIVO	APORTE	8	Semana: 14 (09-DIC-19 al 14-DIC-19)
Evaluación escrita	examen escrito	ANÁLISIS Y GESTIÓN DEL RIESGO, RIESGO DE CREDITO, RIESGO DE MERCADO Y LIQUIDEZ, RIESGO OPERATIVO, RIESGO Y RENDIMIENTO, VAR PARAMÉTRICO Y NO PARAMÉTRICO, VOLATILIDAD	EXAMEN	20	Semana: 19 (13-ENE-20 al 18-ENE-20)
Evaluación escrita	prueba escrita	ANÁLISIS Y GESTIÓN DEL RIESGO, RIESGO DE CREDITO, RIESGO DE MERCADO Y LIQUIDEZ, RIESGO OPERATIVO, RIESGO Y RENDIMIENTO, VAR PARAMÉTRICO Y NO PARAMÉTRICO, VOLATILIDAD	SUPLETORIO	20	Semana: 21 (al)

Metodología

Criterios de evaluación

6. Referencias

Bibliografía base

Libros

Autor	Editorial	Título	Año	ISBN
ALFONSO DE LARA HARO		MEDICIÓN Y CONTROL DE RIESGOS FINANCIEROS	2005	
PEIJIE WANG		FINANCIAL ECONOMETRIC	2009	

Web

Autor	Título	Url
Kontu¿, Eleonora	Ebsco Host	http://web.ebscohost.com/ehost/results?sid=f2e23d52-b049-4dfb-9519-e8cea88f0b1c%40sessionmgr10&vid=3
Mariana Mazz	Oxford Journals	http://icc.oxfordjournals.org/content/current

Software

Revista

Bibliografía de apoyo

Libros

Autor	Editorial	Título	Año	ISBN
julio Cesar AlfonsoLuis Berggrun	Ecoe Ediciones	Introducción al análisis de riesgos financiero		9789587711899

Autor	Editorial	Título	Año	ISBN
ORLANDO MOSCOTE FLÓREZ	eBook	ELEMENTOS DE ESTADÍSTICA EN RIESGO FINANCIERO		

Web

Software

Revista

Docente

Director/Junta

Fecha aprobación: 05/09/2019

Estado: Aprobado