



## FACULTAD DE CIENCIAS DE LA ADMINISTRACIÓN ESCUELA DE ECONOMÍA EMPRESARIAL

### 1. Datos generales

**Materia:** GESTIÓN DE RIESGOS PARA ECE  
**Código:** FAD0117  
**Paralelo:** B  
**Periodo :** Septiembre-2021 a Febrero-2022  
**Profesor:** ORELLANA OSORIO IVAN FELIPE  
**Correo electrónico:** ivano@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, covarianza 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 evalúan 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
7.1	Normativa referente a riesgo Operativo
7.2	Administración del riesgo operativo
7.3	Modelos de Riesgo operativo

## 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
--	---------------------

-Establece las fuentes de financiamiento que ofrece el mercado y estima el riesgo de crédito, liquidez y operativo, con honestidad	-Evaluación escrita
--	---------------------

##### 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
---	---------------------

-Construye e interpretar los indicadores económicos y financieros de la empresa con honestidad.	-Evaluación escrita
---	---------------------

##### 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
--	---------------------

-Evalúa la información de los mercados financieros con objetividad	-Evaluación escrita
--	---------------------

##### 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
--	---------------------

-Evalúa los instrumentos para la gestión de riesgos con ecuanimidad	-Evaluación escrita
---	---------------------

## Desglose de evaluación

Evidencia	Descripción	Contenidos sílabo a evaluar	Aporte	Calificación	Semana
Evaluación escrita	Promedio de aportes	ANÁLISIS Y GESTIÓN DEL RIESGO, RIESGO Y RENDIMIENTO, VOLATILIDAD	APORTE	10	Semana: 5 (18-OCT-21 al 23-OCT-21)
Evaluación escrita	promedio de aportes	RIESGO DE CREDITO, VAR PARAMÉTRICO Y NO PARAMÉTRICO	APORTE	10	Semana: 10 (22-NOV-21 al 27-NOV-21)
Evaluación escrita	promedio de aportes	RIESGO DE MERCADO Y LIQUIDEZ, RIESGO OPERATIVO	APORTE	10	Semana: 15 ( al )
Evaluación escrita	examen final	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: 19-20 (23-01-2022 al 29-01-2022)
Evaluación escrita	supletorio	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 (07-FEB-22 al 07-FEB-22)

## 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
Kontuğ, Eleonora	Ebsco Host	<a href="http://web.ebscohost.com/ehost/results?sid=f2e23d52-b049-4dfb-9519-e8cea88f0b1c%40sessionmgr10&amp;vid=3">http://web.ebscohost.com/ehost/results?sid=f2e23d52-b049-4dfb-9519-e8cea88f0b1c%40sessionmgr10&amp;vid=3</a>
Mariana Mazz	Oxford Journals	<a href="http://icc.oxfordjournals.org/content/current">http://icc.oxfordjournals.org/content/current</a>

#### Software

#### Revista

### Bibliografía de apoyo

#### Libros

#### Web

#### Software

\_\_\_\_\_  
Docente

\_\_\_\_\_  
Director/Junta

Fecha aprobación: **14/01/2022**

Estado: **Aprobado**