

Sílabo de Gestión y Control del Riesgo

I. Datos Generales

Código				
Carácter	Obligatorio			
Créditos	3			
Periodo Académico	2018 - I			
Prerrequisito				
Horas	Teóricas:		Prácticas:	
Docente	Ing. León Minaya, Luis Alberto			

II. Sumilla de la Asignatura

La asignatura contiene:

Riesgo de mercado, una aproximación; el valor en riesgo como medida del riesgo de mercado; el cálculo del valor en riesgo analítico: la matriz de varianzas – covarianzas; el cálculo del valor en riesgo: enfoque global y análisis complementarios a las metodología.

III. Competencia

Analiza el mercado del dinero y define estructuras de inversiones que involucre el análisis del riesgo desde la óptica de inversión y crédito, basados en los distintos instrumentos de riesgo financiero.

IV. Organización de los Aprendizajes

Unidad	Conocimientos	Procedimientos	Actitudes
I	Función de la administración de riesgos. Rendimiento y riesgo. La volatilidad. Modelo de valor de riesgos.	Analiza la importancia de una adecuada función de administración de riesgos. Identifica las fuentes de riesgo. Describe la relación entre el rendimiento y riesgo. Analiza el modelo de volatilidad y el modelo de valor de riesgos para una mejor toma de decisiones.	Asume una actitud crítica y técnica frente a la función de la administración de riesgos, rendimiento y riesgo, la volatilidad y el modelo de valor de riesgos.
II	El valor en riesgo como medida de valor de riesgo. Riesgo en TI. Riesgo en SI.	Determina la cobertura apropiada, reconociendo el valor en riesgo. Identifica los riesgos en el mercado de dinero y en productos derivados, analizando la tipificación de los mismos y utilizando las herramientas financieras.	Asume una actitud crítica y técnica frente al valor en riesgo, riesgo en el mercado de dinero y el riesgo en productos derivados.
Evaluación Parcial			
III	Modelo de Montecarlo. Pruebas de Backtesting y Stess testing. Modelo de Gestión riesgo.	Evalúa el modelo de Montecarlo, las pruebas de Backtesting y Stess testing para asegurar un análisis y pronóstico adecuado frente a los riesgos. Evalúa el modelo de riesgo de crédito, usando técnicas de pronóstico de riesgos.	Asume una actitud crítica y técnica frente al modelo de Montecarlo, las pruebas de Backtesting y Stess testing y el modelo de riesgo de crédito.
IV	Evaluación de Riesgos. Medidas de desempeño ajustadas por riesgo. Riesgo operativo.	Aplica diversos instrumentos de cuantificación de riesgo. Analiza el desempeño a través del uso de las herramientas de medición basadas en el riesgo. Investiga la obtención de resultados acordes al riesgo operativo.	Asume una actitud crítica y técnica frente a las medidas de desempeño ajustadas por riesgo y riesgo operativo.
Evaluación Final			

V. Estrategias Metodológicas

Los contenidos y las actividades propuestas, se desarrollarán siguiendo la secuencia teoría- práctica, haciendo uso de métodos activos, propiciando en los estudiantes el aprendizaje invertido y aprendizaje cooperativo, en el que reflexionen de sus procesos de aprendizaje. Asimismo, se propiciará el trabajo en equipo, utilizando casos, investigación bibliográfica, investigación vía internet, consulta a expertos, lectura compartida, resúmenes, diálogo, debate y exposición. Además, se hará uso permanente de los recursos virtuales y el material de aprendizaje.

VI. Sistema de Evaluación

Rubros	Instrumentos	Peso
Evaluación de entrada	Prueba objetiva	Requisito
Consolidado 1	Prueba de desarrollo Prueba mixta	20%
Evaluación Parcial	Prueba mixta	20%
Consolidado 2	Prueba de desarrollo Prueba mixta	20%
Evaluación Final	Prueba de desarrollo	40%
Evaluación de recuperación	Prueba de desarrollo	

(*) Reemplaza la nota más baja obtenida en los rubros anteriores

Fórmula para obtener el promedio:

$$PF = C1 (20\%) + EP (20\%) + C2 (20\%) + EF (40\%)$$

VII. Bibliografía

7.1 Básica

- **LARA HARO, Alfonso.** *Medición y control de riesgo financiero.* 3ª Ed. México DF: Editorial Limusa SA.
- **FERIA DOMÍNGUEZ, José M.** *El riesgo de mercado, su medición y control.* 1ª ed. Madrid: Editorial Delta Publicaciones.