

SÍLABO

Gestión Integral de Riesgo

| | | | |
|----------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Código | ASUC01338 | Carácter | Obligatorio |
| Prerrequisito | Tributación | | |
| Créditos | 4 | | |
| Horas | Teóricas | 2 | Prácticas 4 |
| Año académico | 2022 | | |

I. Introducción

.Gestión Integral del Riesgo es una asignatura de especialidad de carácter obligatorio que se ubica en el sétimo periodo de la Escuela Académico Profesional de Administración y Finanzas. Tiene como prerrequisito Tributación. La asignatura desarrolla, en un nivel logrado, la competencia transversal Evaluación del Entorno de Negocios y las competencias específicas: Gestión Financiera y Gestión de Instituciones Financieras. En virtud de lo anterior, la relevancia de la asignatura se fundamenta en que permite evaluar el impacto de los factores del entorno aplicando las herramientas de análisis.

Los contenidos que la asignatura desarrolla son: función de la administración de riesgos, modelo de valor de riesgos, riesgo en el mercado de dinero y en productos derivados, modelo de Montecarlo, pruebas de *Backtesting* y *Stess testing*, modelo de riesgo de crédito, medidas de desempeño ajustadas por riesgo, riesgo operativo.

II. Resultado de aprendizaje de la asignatura

Al finalizar la asignatura, el estudiante será capaz de aplicar las distintas metodologías de análisis y riesgos haciendo uso de herramientas financieras de inversión, financiamiento, la planificación y control del mismo.

III. Organización de los aprendizajes

| Unidad 1 La función de administración de riesgos y el rendimiento – modelo valor en riesgo | | Duración en horas | 24 |
|---|---|-------------------|-----------|
| Resultado de aprendizaje de la unidad: | Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de identificar los riesgos a los que están expuestas las empresas y las oportunidades, evitando y mitigando pérdidas, y el análisis de la volatilidad para el cálculo y control de los riesgos de mercado. | | |
| Ejes temáticos: | <ol style="list-style-type: none"> 1. La función de administración de riesgos 2. Rendimiento y riesgo 3. La volatilidad 4. Modelo de valor en riesgo | | |

| Unidad 2 Riesgo en el mercado de dinero y en productos derivados | | Duración en horas | 24 |
|---|---|-------------------|-----------|
| Resultado de aprendizaje de la unidad: | Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de analizar los riesgos en el mercado de dinero y en productos derivados, revisando la tipificación de los mismos, a través del uso de las herramientas financieras. | | |
| Ejes temáticos: | <ol style="list-style-type: none"> 1. Riesgo en el mercado de dinero 2. Riesgo en productos derivados 3. Valor en riesgo para un portafolio de instrumentos de deuda | | |

| Unidad 3 Modelo Montecarlo – pruebas de backtesting y stress testing y el modelo de riesgo de crédito | | Duración en horas | 24 |
|--|---|-------------------|-----------|
| Resultado de aprendizaje de la unidad: | Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de analizar el modelo Montecarlo, las pruebas de <i>backtesting - stress testing</i> y el modelo de riesgo de crédito usando técnicas de pronósticos de riesgos. | | |
| Ejes temáticos: | <ol style="list-style-type: none"> 1. Modelo Montecarlo 2. Pruebas de <i>backtesting y stress testing</i> 3. Modelo de riesgo de crédito | | |

| Unidad 4 Credit var – medidas de desempeño ajustadas por riesgo y riesgo operativo | | Duración en horas | 24 |
|---|---|-------------------|-----------|
| Resultado de aprendizaje de la unidad: | Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de aplicar diversos instrumentos de cuantificación de riesgos y el análisis del desempeño a través del uso de las herramientas de medición basadas en el riesgo. | | |
| Ejes temáticos: | <ol style="list-style-type: none"> 1. <i>Credit var</i> 2. Medidas de desempeño ajustadas por riesgo 3. El riesgo operativo | | |

IV. Metodología

Modalidad Presencial Blended

La presente asignatura utilizará la metodología experiencial y colaborativa, promoviendo la participación constante de los estudiantes.

Se utilizará:

- Aprendizaje colaborativo
- Método de casos
- Clase magistral activa

V. Evaluación

Modalidad presencial Blended

| Rubros | Unidad por evaluar | Fecha | Entregable / Instrumento | Peso parcial | Peso Total |
|---------------------------------|--------------------|---------------------------------------|---|--------------|------------|
| Evaluación de entrada | Prerrequisito | Primera sesión | - Evaluación escrita teórica / Prueba objetiva | 0% | |
| Consolidado 1 C1 | 1 | Semana 4 | - Evaluación teórico-práctica / Prueba de desarrollo | 70% | 20% |
| | 2 | Semana 7 | - Exposición grupal / Rúbrica de evaluación | 30% | |
| | | | - Actividades de trabajo autónomo en línea | | |
| Evaluación parcial EP | 1 y 2 | Semana 8 | - Evaluación teórico-práctica / Prueba de desarrollo | 20% | |
| Consolidado 2 C2 | 3 | Semana 12 | - Evaluación teórico-práctica / Prueba de desarrollo | 70% | 20% |
| | 4 | Semana 15 | - Exposición grupal / Rúbrica de evaluación | 30% | |
| | | | - Actividades de trabajo autónomo en línea | | |
| Evaluación final EF | Todas las unidades | Semana 16 | - Elaboración de proyecto / Rúbrica de evaluación | 40% | |
| Evaluación sustitutoria * | Todas las unidades | Fecha posterior a la evaluación final | - Aplica | | |

* Reemplaza la nota más baja obtenida en los rubros anteriores.

Fórmula para obtener el promedio:

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

VI. Bibliografía

Básica:

De Lara, A. (2008). *Medición y control de riesgo financiero*. (3.ª ed.). Limusa.

<http://bit.ly/2Kf4Zht>

Feria, J. (2005). *El riesgo de mercado: su medición y control*. Delta. <http://bit.ly/3reCUaX>

Complementaria:

Bravo, O. y Sánchez. M. (2012). *Gestión integral de riesgos*. Bravo & Sánchez.

Casares, I. y Lizaraburu, E. (2016). *Introducción a la gestión integral de riesgos empresariales. Enfoque ISO 31000*. Platinum Editorial SAC

VII. Recursos digitales:

Software Shop (versión 2020). *Risk Simulato*.

<https://www.software-shop.com/producto/risk-simulator>