



## 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-2016 a Febrero-2017

**Profesor:** JARAMILLO VERDUGO CARLOS FABIAN

**Correo electrónico** cfjaramillo@uazuay.edu.ec

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

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.

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.

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

#### 3. Contenidos

<b>1.</b>	<b>Introducción a la Administración Estratégica</b>
1.01.	Generalidades (1 horas)
1.02.	Liderazgo estratégico (1 horas)
1.03.	El proceso de preparación de estrategias (1 horas)
1.04.	Las estrategias empresariales (1 horas)
1.05.	El análisis FODA y modelo de negocio (2 horas)
1.06.	Las cinco Fuerzas de Portes y la Cadena de Valor: de Mckinsey y de Porter (2 horas)
1.07.	Aplicaciones prácticas a empresas de la región y país (2 horas)
<b>2.</b>	<b>Aspectos Básicos del Riesgo Empresarial</b>
2.01.	Antecedentes (1 horas)
2.02.	Definiciones: Riesgo e Incertidumbre (1 horas)
2.03.	Tipos de Riesgos (1 horas)
2.04.	La gestión de riesgos (1 horas)
2.05.	Riesgo empresarial (2 horas)
2.06.	Riesgo por línea de negocio (2 horas)
2.07.	Riesgo por actividades (2 horas)
<b>3.</b>	<b>IDENTIFICACION DE RIESGOS 10</b>
3.01	Herramientas de identificación 1 (1 horas)
3.02	Métodos de identificación 1 (3 horas)
3.03	Matriz de control 1 (1 horas)
3.04	Análisis de vulnerabilidad 1 (1 horas)

3.05	El método RISICAR 6 (5 horas)
<b>4.</b>	<b>CALIFICACION Y EVALUACION DE RIESGOS</b>
4.01	Métodos de calificación de los riesgos (1 horas)
4.02	Calificación en el método matriz de control (1 horas)
4.03	Método Septri (1 horas)
4.04	Calificación en el método matriz de vulnerabilidad (1 horas)
4.05	Calificación en el método RISICAR (3 horas)
4.06	Métodos de evaluación de riesgos en cada uno de los métodos. (1 horas)
<b>5.</b>	<b>Modelación y Teoría del Riesgo</b>
5.01.	El riesgo de crédito (1 horas)
5.01.	Tipos de modelos de probabilidad (2 horas)
5.02.	Distribución de una pérdida asociada a un evento contingente (3 horas)
5.02.	Metodologías de medición (1 horas)
5.03.	Marco conceptual del riesgo de crédito (1 horas)
5.03.	Modelación de una pérdida (3 horas)
5.04.	Metodologías para la estimación del riesgo de crédito (2 horas)
5.04.	Modelo de Riesgo individual (2 horas)
5.05.	El riesgo de liquidez y de tasas de interés (1 horas)
5.06.	Medición del riesgo (4 horas)
5.07.	El riesgo de mercado (2 horas)
5.08.	El riesgo operativo (2 horas)
5.09.	Estándares mínimos para la aplicación (1 horas)
<b>6.</b>	<b>Gestión de Riesgos Financieros</b>

#### 4. Sistema de Evaluación

Resultado de aprendizaje de la carrera relacionados con la materia

Resultado de aprendizaje de la materia	Evidencias
<b>ax. Conocer los mecanismos de financiación de la Empresa.</b>	
-Establece la situación económica, financiera y de riesgo actual de la empresa, técnicamente	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
-Establece las fuentes de financiamiento que ofrece el mercado y estima el riesgo de crédito, liquidez y operativo, con honestidad	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
<b>ay. Generar e interpretar los balances contables y los indicadores económicos de la empresa.</b>	
-Conoce los indicadores económicos y financieros de la empresa.	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
-Construye e interpretar los indicadores económicos y financieros de la empresa con honestidad.	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros

Resultado de aprendizaje de la materia	Evidencias
<b>ba. Dar seguimiento al mercado financiero local, nacional y global.</b>	
-Aplica técnicas de análisis para medición de riesgo de mercado de derivados, tasa de interés y descalce de plazos	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
-Evalúa la información de los mercados financieros con objetividad	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
<b>bb. Pronosticar el comportamiento macro y microeconómico y su influencia en la toma de decisiones de las organizaciones económicas públicas y privadas.</b>	
-Aplica los modelos de probabilidad bajo el enfoque del riesgo	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros
-Evalúa los instrumentos para la gestión de riesgos con ecuanimidad	-Evaluación escrita -Evaluación escrita -Reactivos -Reactivos -Resolución de ejercicios, casos y otros -Resolución de ejercicios, casos y otros

### Desglose de evaluación

Evidencia	Descripción	Contenidos sílabo a evaluar	Aporte	Calificación	Semana
Resolución de ejercicios, casos y otros	Capítulo 1,2		APORTE 1	4	Semana: 5 (10/10/16 al 15/10/16)
Evaluación escrita	Capítulos 1-2		APORTE 1	6	Semana: 5 (10/10/16 al 15/10/16)
Resolución de ejercicios, casos y otros	Capítulos 3,4		APORTE 2	4	Semana: 10 (14/11/16 al 19/11/16)
Evaluación escrita	Capítulo 3,4		APORTE 2	6	Semana: 10 (14/11/16 al 19/11/16)
Resolución de ejercicios, casos y otros	Capítulos finales		APORTE 3	4	Semana: 15 (19/12/16 al 23/12/16)
Evaluación escrita	Capítulos finales		APORTE 3	6	Semana: 15 (19/12/16 al 23/12/16)
Resolución de ejercicios, casos y otros	Trabajo todos los capítulos		EXAMEN	8	Semana: 17-18 (02-01-2017 al 15-01-2017)
Evaluación escrita	Todos los contenidos		EXAMEN	12	Semana: 17-18 (02-01-2017 al 15-01-2017)
Evaluación escrita	Todos los capítulos		SUPLETORIO	20	Semana: 19-20 (16-01-2017 al 22-01-2017)

### Metodología

La asignatura de Gestión de Riesgos se desarrollará a través de una metodología totalmente activa, acercando en todo momento los conceptos teóricos a la realidad concreta de los estudiantes, sin hacerles perder la perspectiva global, es decir, se manejará un pesar global con un actual local, lo que producirá un aprendizaje significativo.

Se utilizará entre otras las siguientes estrategias metodológicas: clases magistrales, aprendizaje basado en problemas y estudio de casos prácticos, trabajos en equipo e individuales.

### Criterios de Evaluación

La evaluación será un proceso permanente y se realizará en todas las actividades que el alumno realice dentro y fuera del aula.

- Evaluación escrita: Se realizará al finalizar cada bloque temático y serán comunicados previamente a los estudiantes.
- Reactivos: pruebas escritas cortas que refuercen conocimientos previos.

· Trabajos dentro y fuera de clase: Consistirán en la resolución individual o grupal de ejercicios y casos prácticos, dentro y fuera del aula.

La copia y el plagio serán considerados como faltas académicas y administrativas muy graves, por lo que los estudiantes que cometan estas faltas, tendrán automáticamente 0 (cero) en la materia y además se solicitará a las instancias universitarias respectivas su sanción.

La asistencia no puede ser considerada como aporte y el reglamento de la Universidad del Azuay, no contempla la exoneración del examen final.

## 5. Referencias

### Bibliografía base

#### Libros

---

#### Web

Autor	Título	URL
Kontuž, Eleonora	Ebsco Host	<a href="http://web.ebscohost.com/ehost/results?sid=f2e23d52-b049-">http://web.ebscohost.com/ehost/results?sid=f2e23d52-b049-</a>
Mariana Mazz	Oxford Journals	<a href="http://icc.oxfordjournals.org/content/current">http://icc.oxfordjournals.org/content/current</a>

#### Software

---

### Bibliografía de apoyo

#### Libros

Autor	Editorial	Título	Año	ISBN
Mejía, Rubí Consuelo	Universidad EAFIT	Identificación de Riesgos	2013	978-958-720-171-0
David, Fred	Pearson	Conceptos de Administración Estratégica	2013	9786073238101
Mejía, Rubí Consuelo	Universidad Eafit	Administración de Riesgos, un enfoque Empresarial	2008	958-8281-23-7

#### Web

Autor	Título	URL
Estupiñán Gaitán, Rodrigo	Ebrary	<a href="http://site.ebrary.com/lib/uasuaysp/detail.action?">http://site.ebrary.com/lib/uasuaysp/detail.action?</a>

#### Software

---

\_\_\_\_\_  
Docente

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

Fecha aprobación: **19/09/2016**

Estado: **Aprobado**