ATMIRE

Title	Gestión Del Riesgo-BA26-201900
Item Type	info:eu-repo/semantics/report
Authors	Anaya Ramirez Andrea Vannessa;Seminario Morales Enrique
Publisher	Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas (UPC)
Rights	info:eu-repo/semantics/openAccess;Attribution-NonCommercial-ShareAlike 3.0 United States
Download date	2026-11-27 08:06:41
Item License	http://creativecommons.org/licenses/by-nc-sa/3.0/us/
Link to Item	http://hdl.handle.net/10757/632111

I. INFORMACIÓN GENERAL

CURSO	:	Gestión del Riesgo
CÓDIGO	:	BA26
CICLO	:	201900
CUERPO ACADÉMICO	:	**Anaya Ramírez, Andrea Vannessa** **Seminario Morales, Enrique**
CRÉDITOS	:	5
SEMANAS	:	8
HORAS	:	10 H (Teoría) Semanal
ÁREA O CARRERA	:	Banca Epe

II. MISIÓN Y VISIÓN DE LA UPC

Misión: Formar líderes íntegros e innovadores con visión global para que transformen el Perú.

Visión: Ser líder en la educación superior por su excelencia académica y su capacidad de innovación.

III. INTRODUCCIÓN

Curso de especialidad en la carrera de Administración de Banca y Finanzas, de carácter teórico-práctico dirigido a los alumnos del sexto ciclo, que busca desarrollar la competencia general de Comunicación Oral (Nivel 2) y la competencia específica de Gestión Financiera (Nivel 2).

Vivimos en un entorno cambiante en la cual las empresas a nivel mundial están constantemente en la búsqueda de profesionales que contribuyan en la implementación de las mejores prácticas en la gestión de los diferentes riesgos financieros y no financieros, que ayuden a la organización a administrar en forma eficiente los recursos en la búsqueda de una rentabilidad esperada, considerando un nivel de riesgo acorde con su tolerancia a las pérdidas.

El desarrollo del curso busca brindar los conceptos y herramientas en la gestión de riesgos, formar los criterios básicos para su implementación en la práctica y utilizar diversas fuentes de información que posibiliten la toma de decisiones en forma razonada, y asumiendo un nivel de riesgo consciente en la búsqueda de resultados positivos en los negocios.

IV. LOGRO (S) DEL CURSO

Al finalizar el curso, el estudiante explica los indicadores financieros de la empresa y el nivel de riesgo en el que se desarrolla, y expone en forma clara las diferentes alternativas de gestión.

V. UNIDADES DE APRENDIZAJE

UNIDAD Nº: 1 INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

LOGRO

Al finalizar la Unidad 1, el estudiante describe los conceptos más importantes sobre la gestión de riesgos financieros y no financieros.

TEMARIO

Los riesgos en la empresa
Organización empresarial en la gestión de riesgos
Tipos de riesgo
Formas de gestionar el riesgo
ISO 31000
- Introducción a la Gestión Integral de Riesgos
- Principios, componentes y marco de trabajo

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 1

UNIDAD Nº: 2 GESTIÓN DEL RIESGO DE MERCADO Y RIESGO DE CRÉDITO

LOGRO

Al finalizar la Unidad 2, el estudiante explica las diferentes herramientas para la medición y gestión de los riesgos de mercado y crédito.

TEMARIO

Riesgo de Mercado
- Riesgo de Tasa de Interés
- Riesgo Cambiario
- Riesgo de Precio
- Principales técnicas de medición (aplicación práctica)
- Capital Asset Pricing Model (CAPM)
- Duración y Duración Modificada
- Modelos Value At-Risk (VAR)
- Principales herramientas para la Gestión de los Riesgos de Mercado (aplicación práctica)
- Forward de divisas (FWD)
- Forward de tasas de interés (FRA)
- Permutas financieras (SWAP)
- Opciones
- Revisión del marco regulatorio en el sistema financiero peruano

Riesgo de Crédito
- Etapas del Riesgo de Crédito
- Principales técnicas para la Gestión del Riesgo de Crédito
- Riesgo de Crédito en las instituciones financieras
- Revisión del marco regulatorio en el sistema financiero peruano

HORA(S) / SEMANA(S)

Semanas 2, 3 y 4

UNIDAD Nº: 3 GESTIÓN DEL RIESGO DE OPERACIÓN, CONTINUIDAD DEL NEGOCIO Y SEGURIDAD DE LA INFORMACIÓN

LOGRO

Al finalizar la Unidad 3, el estudiante explica las diferentes herramientas para la gestión del Riesgo de Operación, Continuidad del Negocio y Seguridad de la Información.

TEMARIO

Riesgo de Operación
- Principales conceptos sobre la Gestión del Riesgo de Operación
- Revisión del marco regulatorio en el sistema financiero peruano
- Riesgos asegurables y pólizas de seguro

Continuidad del Negocio y Seguridad de la Información
- Principales conceptos sobre la Gestión de la Continuidad del Negocio y Seguridad de la Información.
- Plan de Continuidad del Negocio (BIA)
- Revisión del marco regulatorio en el sistema financiero peruano

HORA(S) / SEMANA(S)

Semanas 5 y 6

UNIDAD Nº: 4 COMITÉ DE BASILEA

LOGRO

Al finalizar la Unidad 4, el estudiante explica los diferentes conceptos sobre estándares internacionales de gestión de riesgo en instituciones financieras.

TEMARIO

Principios y objetivos
Acuerdos de Basilea I y II
Revisión del marco regulatorio en el sistema financiero peruano

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 7

VI. METODOLOGÍA

El curso se desarrolla bajo la modalidad blended, por lo que en todas las semanas se contará con sesiones presenciales y sesiones online. Estas sesiones online se realizan a través de diferentes actividades que se trabajan en el Aula Virtual (AV) con el soporte, guía y retroalimentación del docente.

Tanto las clases presenciales como online requieren de la participación activa y continua del estudiante. Corresponderá al alumno revisar diferentes materiales (como lecturas y material multimedia, entre otros) disponibles en el Aula Virtual y desarrollar las actividades planteadas en la Guía del Estudiante. Toda consulta al docente respecto al desarrollo del curso se realiza a través del foro de dudas académicas.

VII. EVALUACIÓN

FÓRMULA

15% (PC1) + 20% (PC2) + 15% (PA1) + 20% (TF1) + 30% (EB1)

TIPO DE NOTA	PESO %
PC - PRÁCTICAS PC	15
PC - PRÁCTICAS PC	20
PA - PARTICIPACIÓN	15
TF - TRABAJO FINAL	20
EB - EVALUACIÓN FINAL	30

VIII. CRONOGRAMA

Módulo Regular

TIPO DE PRUEBA	DESCRIPCIÓN NOTA	NÚM. DE PRUEBA	FECHA	OBSERVACIÓN	RECUPERABLE
PC	PRÁCTICAS PC	1	Semana 4	Presencial	SÍ
PC	PRÁCTICAS PC	2	Semana 6	Presencial	SÍ
PA	PARTICIPACIÓN	1	Semana 7	Promedio de 3 foros virtuales	NO
TF	TRABAJO FINAL	1	Semana 7	Promedio de 3 avances y trabajo final	NO
EB	EVALUACIÓN FINAL	1	Semana 8	Presencial	SÍ

IX. BIBLIOGRAFÍA DEL CURSO

https://upc.alma.exlibrisgroup.com/leganto/readinglist/lists/3710017770003391?institute=51UPC_INST&auth=LOCAL