

Maestría en Gestión de Riesgos Financieros

Sumilla MGR / Malla versión 2793-2023-01



ASIGNATURA	SUMILLA
Fundamentos de la Gestión del Riesgo	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes comprenderán la gerencia de riesgos y su evolución, así como el concepto de riesgo, sus impactos y su implicación en la toma de decisiones en la empresa. Identificarán los tipos de riesgo a los que se puede enfrentar la empresa, los sistemas de evaluación de estos, el tratamiento y sus mecanismos de control y financiación. Analizarán las implicaciones que tiene la toma de decisiones basada en riesgos en el contexto del gobierno corporativo, así como los modelos que lo respaldan o el reporte en riesgos que deben analizar los consejos de administración y los distintos modelos que intentan explicar desde diferentes ámbitos los riesgos a los que se van a enfrentar las empresas: financieros, derivados del proceso productivo, tecnológicos, sociales, políticos, etc. Por último, valorarán la ética en los negocios y el desarrollo de los códigos de conducta que protejan a la entidad y satisfagan los objetivos perseguidos.</p>
Análisis Cuantitativo Avanzado	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes comprenderán los fundamentos estadísticos y técnicos necesarios para modelizar riesgos financieros y la utilización práctica de las herramientas estadísticas y cuantitativas necesarias para gestionar los riesgos financieros. Así, interpretarán y utilizarán un conjunto de métodos cuantitativos matemáticos, estadísticos y econométricos de análisis avanzado para la estimación y contraste de modelos de análisis financiero, de inversiones, de gestión de fondos y de gestión de riesgos; desarrollarán la capacidad de valorar de forma crítica los trabajos realizados por terceros que utilicen técnicas cuantitativas y aprenderán a interpretar los resultados de estos modelos para utilizarlos en los procesos de toma de decisiones. Además, desarrollarán la capacidad de utilizar herramientas de software para la resolución de problemas financieros reales, interpretar adecuadamente los resultados obtenidos y extraer conclusiones útiles para elaborar informes a partir del análisis realizado.</p>

ASIGNATURA	SUMILLA
Mercados Financieros y Productos Financieros	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes comprenderán el funcionamiento del mercado de divisas y el mercado de renta fija, los diferentes instrumentos que se negocian en los mismos y las operaciones más comunes desarrolladas en cada mercado. Analizarán las diferentes teorías que explican la formación de estas importantes variables financieras y sus principales medidas de sensibilidad e identificarán los principales factores que afectan al nivel de los tipos de interés y tipos de cambio (sin duda las dos principales fuentes de riesgo de mercado que afectan a las compañías), cómo poder analizar la sensibilidad que tienen los resultados de las empresas ante una variación de estas magnitudes y cómo el mercado de derivados ofrece herramientas para poder gestionar, reducir e incluso llegar a eliminar estos generadores de incertidumbre.</p>
Modelos de Valoración y Riesgo	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes adquirirán las herramientas y el criterio que les permitan ser competentes para analizar cada posibilidad de inversión bajo modelos que brinden mayor certeza al inversionista para su oportuna toma de decisiones. Serán capaces de implementar los análisis estadísticos y financieros más contemporáneos que les garanticen realizar proyecciones acertadas, siempre tomando en cuenta el perfil de sus inversionistas.</p>
Metodología de la Investigación I	<p>La asignatura tiene como propósito fortalecer en los estudiantes las competencias sobre métodos y técnicas de investigación a través de los siguientes contenidos académicos: el trabajo de investigación, modalidades de trabajo de investigación, estructura del trabajo de investigación estructura del plan, el título del tema y el planteamiento del problema.</p>
Gestión y Medición del Riesgo de Mercado	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes abordarán las cuestiones más relevantes del riesgo de mercado con el objetivo de que sean capaces de cuantificar las pérdidas debidas a cambios imprevistos en los factores de riesgo y llevar a cabo la medición de las pérdidas potenciales provenientes por cambios en los principales factores de los mercados financieros: tipos de interés, precios, tipos de cambio, spreads crediticios.</p>

ASIGNATURA	SUMILLA
<p>Gestión y Medición del Riesgo de Crédito</p>	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes adquirirán las herramientas y el criterio que les permitan analizar cada posibilidad de crédito, independientemente de las características del otorgante, del receptor y del tipo de crédito. Comprenderán los diferentes modelos que brinden mayor certeza a la sociedad inversionista otorgante de créditos para su oportuna toma de decisiones y serán capaces de implementar análisis estadísticos y financieros más contemporáneos que les garanticen realizar otorgamiento de créditos de forma correcta, siempre tomando en cuenta el perfil de sus solicitantes de una forma ética sin considerar factores intrínsecos que rayen en la discriminación.</p>
<p>Gestión Integrada y Riesgo Operacional</p>	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes profundizarán en la medición y gestión del riesgo operacional, identificando métodos de gestión del riesgo en la empresa, incluyendo modelos de gestión del riesgo integrales como el ERM, modelos cuantitativos de estimación de la carga de capital para fines regulatorios, pasando por el análisis de riesgos tan actuales como el blanqueo de capitales y financiación del terrorismo o los ciberriesgos, con el objetivo de que sean capaces de aplicar modelos y herramientas necesarios para su detección, seguimiento y control y para que puedan tomar decisiones en diferentes entornos de riesgo, operacionales y tecnológicos.</p>
<p>Gestión de Riesgo en Inversiones</p>	<p>Al término de la asignatura, los estudiantes comprenderán el riesgo de un conjunto de activos, es decir, de una cartera. Para ello, en primer lugar, analizarán el proceso de construcción de una cartera y los principales tipos de carteras que pueden llevarse a cabo. Posteriormente, profundizarán en el análisis de riesgo de una cartera, haciendo hincapié en los principales ratios de riesgo y de rentabilidad-riesgo (tales como Sharpe, Treynor o Sortino), con el objetivo de que sean capaces de evaluar el desempeño de una cartera en tres dimensiones: rentabilidad, riesgo y rentabilidad-riesgo.</p>
<p>Metodología de la Investigación II</p>	<p>La asignatura es de carácter tiene como propósito desarrollar en los maestrantes competencias cognitivas que le permitan conocer y dominar el proceso de la investigación científica en su enfoque cualitativo, cuantitativo y mixto. Se revisa el método para que los alumnos puedan formular un problema de investigación, construir las hipótesis y objetivos, así como plantear la justificación que permita validar el desarrollo de la labor investigativa.</p>