



DIVISIÓN:	CIENCIAS ECONÓMICAS Y ADMINISTRATIVAS
FACULTAD	ADMINISTRACIÓN DE EMPRESAS
PROGRAMA ACADÉMICO:	ESPECIALIZACIÓN EN FINANZAS
DENOMINACIÓN DEL ESPACIO ACADÉMICO	GESTIÓN DEL RIESGO FINANCIERO
METODOLOGÍA	Presencial
NATURALEZA DEL ESPACIO ACADÉMICO:	Teórico-práctico
NÚMERO DE CRÉDITOS ACADÉMICOS	Dos (2)

OBJETIVO/PROPÓSITO

Establecer medidas que permitan administrar los riesgos financieros y de un portafolio de inversiones como apoyo a la toma de decisiones y a la generación de valor para la organización y sus partes interesadas.

Entorno empresarial

- Contextualización de la gestión empresarial.
- Análisis sectorial y de las empresas.
- Toma de decisiones financieras.
- Variables financieras: tiempo, liquidez, rentabilidad y riesgo.
- Portafolio de Inversión:
 - Renta Fija,
 - Renta Variable.
 - Rentabilidad Efectiva Anual Ponderada,
 - Determinación niveles de equilibrio,
 - Márgenes de seguridad
 - Análisis: Fundamental, y Técnico.

FACTORES DE RIESGO

- Riesgo empresarial
 - o Factores de Adversidad Riesgo Empresarial
- Instrumentos de medición y análisis
 - o Perfil de Riesgo
 - o Series de tiempo
 - o Medidas de tendencia central
 - o Regresión Lineal
- Modelos de control de riesgo
 - o Costo Ponderado de Endeudamiento,
 - o Costo de Capital

INDICADORES ESTADÍSTICOS

- Modelos y herramientas estadísticas para la optimización de Portafolios de Inversión
- Medidas de Tendencia central
- Dispersión financiera,
- Correlación de activos financieros.

INDICADORES ESTADÍSTICOS

- Volatilidad,
- Montecarlo Model
- Varianza / Covarianza
- Modelos para la toma de decisiones de optimización de Portafolios de Inversión.