



## ***Programa de Movilidad Internacional de Estudiantes de Posgrado (Maestría y Doctorado) y Profesores Visitantes Latinoamericanos***

### **ANEXO 3: Programa Académico Curso Gestión del Riesgo**

#### **a. Objetivo general**

Proporcionar a los participantes los elementos teóricos y prácticos de la gestión de riesgo de empresas para los cual se estudiarán los elementos conceptuales de economía financiera y econometría, que les permitan desarrollar casos de medición de riesgo, base para entender los mecanismos de cobertura que existen en los mercados internacionales.

#### **b. Objetivos específicos**

- Comprender los conceptos de riesgo e incertidumbre
- Estudiar la gestión de riesgo
- Comprender y aplicar metodologías estadísticas para medición de riesgo
- Medir el riesgo en renta fija
- Estudiar los fundamentos teóricos de la intercompensación riesgo-rentabilidad de una inversión
- Analizar la gestión del riesgo, los tipos de riesgo en la empresa, los modelos para su cuantificación y los instrumentos financieros para su cobertura.
- Estudiar la valoración del riesgo VAR

#### **c. Metodología**

Se desarrollarían temas prácticos sobre medición de riesgo: crédito, cambiario, impuestos, etc. y se trabajarían los mecanismo de cobertura como opciones, forward, futuros, seguros, provisiones, etc. Los estudiantes deben realizar previamente las lecturas indicadas, las cuales se complementarán con la exposición magistral del profesor. Una vez discutida en clase la temática correspondiente, se realizarán talleres que permitan al estudiante aplicar los conceptos teóricos a la solución de problemas específicos.

#### **d. Evaluación**

Los talleres desarrollados serán revisados por el profesor y se efectuará la retroalimentación correspondiente para garantizar el proceso de aprendizaje por parte de los asistentes.



**UNIVERSIDAD SANTO TOMÁS**  
PRIMER CLAUSTRO UNIVERSITARIO DE COLOMBIA  
FACULTAD DE CONTADURÍA PÚBLICA

**e. Programa a desarrollar**

- INCERTIDUMBRE Y RIESGO
- LA GESTIÓN DE RIESGO
  - Conceptos teóricos
  - Riesgo de mercado
  - Riesgo de crédito
  - Riesgo de liquidez
  - Riesgo legal
  - Riesgo operativo
  - Riesgo de reputación
  - El proceso de gestión de riesgo

**f. Docente a cargo:**

- Carlos Arturo Gomez Restrepo: Doctor en Ciencia Economicas y Magister en Administración de la Universidad Nacional de Colombia. Especialista en Finanzas Corporativas de la Universidad de los Andes. Contador Público de profesión, se desempeña actualmente como Decano de la Facultad de Contaduría Pública de la Universidad Santo Tomás. Bogotá-Colombia. y Presidente de la Asociación Nacional de Facultades de Contaduría Pública (ASFACOP). Posee una amplia trayectoria profesional, desempeñándose en importantes cargos en el sector público y privado de Colombia. Su experiencia académica le ha permitido desempeñarse en las principales Universidades del país, como la Universidad Nacional de Colombia, la Universidad Santo Tomás, la Universidad del Rosario tanto en pregrado como en posgrado. Igualmente a nivel internacional, ha sido conferencista y docente invitado en universidades como la Universidad Autónoma de Monterrey, la Universidad Nacional Autónoma de México, Universidad Estadual de Campinas – Brasil y la Universidad de Barcelona.