



Proceso: Formulación del Currículo y Plan de Estudios

Guía de Cátedra

Código: DOC11-FO-01
 Versión: 2
 Fecha: 05/07/2017
 Hoja: Página 1 de 4

1. Identificación del Curso/ Módulo

Nombre del Curso/ Módulo: Riesgo de Liquidez	Línea de conocimiento: Cobertura y Especulación	Código materia: COES	Crédito: 1	Horas totales 48	Horas Clase	16
					Horas Independientes	32

Facultad/ Departamento: **FACULTAD DE INGENIERÍA**

Programa que Administra el curso o módulo: **Especialización en Riesgos Financieros y Mercados de Derivados**

Niveles de Formación	Técnico Profesional		Especialización	X
	Tecnológico Profesional		Maestría	
	Profesional		Doctorado	

Modalidad: Presencial Dual Virtual

Fecha de actualización de la guía: **JULIO DE 2018**

2. Restricciones de:

Conocimiento		Orden
Prerrequisito	NA	
Correquisitos	NA	

3. Justificación

Teniendo en cuenta que la liquidez es la capacidad que tiene una empresa para cubrir sus necesidades de efectivo actuales y futuros, existen diferentes formas de enfrentar el manejo de los riesgos financieros, el riesgo de liquidez no es excepción, dependiendo del tamaño de la empresa o negocio, de la actividad, de los objetivos que persigue, de lo complejo en el desarrollo de sus operaciones y la manera como se utilizan los recursos será la efectividad de su gestión.

Actualmente la alta dirección concibe que la administración del riesgo de liquidez es una función muy importante dentro de la organización que requiere de una preparación cualitativa y cuantitativa de metodologías de medición y gestión para definir un conjunto de estrategias que busque mantener la estabilidad financiera de la empresa y minimizar las pérdidas ocurridas por los diferentes riesgos.

4. Competencias de formación

Competencia	Resultado de aprendizaje esperado
Analiza las características de la empresa expuesta a riesgo de liquidez.	Identifica las características de la liquidez Analiza las causas que lleva a una empresa a exponerse a riesgo de liquidez
Identifica las fuentes generadoras del riesgo de liquidez, y su incidencia en la pérdida esperada.	Identifica fuentes de riesgo de liquidez en situaciones presentadas Evalúa el impacto de la exposición a riesgo de liquidez
Aplica el proceso de administración del riesgo de liquidez, con la propuesta de estrategias de mitigación.	Desarrolla el proceso de gestión del riesgo de liquidez a un caso presentado Propone estrategias de acción para reducir las pérdidas por riesgo de liquidez

Aplica las metodologías de cuantificación del riesgo de liquidez.	Caracteriza los diferentes métodos para cuantificar el riesgo de liquidez Determina la pérdida esperada usando métodos de medición de riesgo de liquidez

5. Contenido de la actividad académica*

Unidad	Temáticas	Horas	Evaluación del aprendizaje
Generalidades del Riesgo Liquidez	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Definiciones ✓ Características e importancia del riesgo de Liquidez ✓ Diferencias principales entre riesgo de liquidez y otros riesgos financieros ✓ Fuentes generadoras del riesgo de liquidez 	2	Talleres y Evaluación Escrita
La administración del riesgo de liquidez	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Identificación ✓ Medición ✓ Control ✓ Monitoreo 	2	Talleres y Evaluación Escrita
Metodologías de cuantificación del riesgo de Liquidez	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Modelo Estándar de Basilea ✓ Gap de Liquidez ✓ Ratios de Liquidez ✓ VaR ajustado por liquidez de mercado ✓ CFaR 	6	Talleres y Evaluación Escrita
Indicadores de Riesgo de Liquidez	<ul style="list-style-type: none"> ✓ IRL ✓ Alertas tempranas de Liquidez 	2	Talleres y Evaluación Escrita
Análisis de escenarios y pruebas de estrés	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Definición de escenarios ✓ Identificar y describir escenarios deterministas ✓ Pruebas de estrés y análisis de sensibilidad ✓ Modelado de escenarios deterministas en múltiples niveles de estrés ✓ Monte Carlo Modelado para capturar los niveles de estrés 	4	Talleres y Evaluación Escrita

Recursos:

6. Estrategias Pedagógicas

Lecturas de temas especializados
 Búsqueda de información complementaria
 Participación en Foros propuestos
 Sigue un método preciso para buscar causas, consecuencias y soluciones en un hecho concreto.

Talleres: Actividad dirigida por el docente en la que el estudiante reafirma un conocimiento abordado con anterioridad.

Sesión presencial: presentación de pautas teóricas por parte del docente
Organización de grupos de trabajo
Conciliación en discusiones temáticas

Otra:

7. Evaluación y Registro de resultados

Evaluar:

1. Elaboración de resúmenes de lecturas de capítulos
2. Preparación y sustentación de exposiciones
3. Elaboración de Mapas conceptuales
4. Examen Escrito (Cuestionario con preguntas cerradas, tipo test de selección múltiple, abiertas, de contraste F/V, otros).
5. Talleres en clase o para desarrollo en horas independientes

El desarrollo de los talleres con la utilización adecuada de un software especial y el análisis e interpretación de los resultados obtenidos.

- Las reflexiones personales después del análisis de los casos, para evaluación su apreciación individual
- La participación en los grupos de discusión para el análisis de estrategias de solución ante una situación planteada
- La capacidad para trabajar en equipo

Calificar:

La calificación tendrá una nota de cero (0) a cinco (5)

Registro:

Procedimiento de como ingresar al portal COSMOS para digitar las notas.

8. Referencias Bibliográficas

Bibliografía UNAB

1. Basel III: The Liquidity Coverage Ratio and liquidity risk monitoring tools
2. Basel III: International framework for liquidity risk measurement, standards and monitoring
3. Matz, Leonard. Liquidity risk measurement and management : base l iii and beyond. Xlibris Corp., 2011. ISBN 9781462892433
4. Matz, Leonard y Peter Neu. Liquidity Risk Measurement and Management: A Practitioner's Guide to Global Best Practices. Wiley Finance. 2007. ISBN 9780470821824
5. Banks, Erik. Liquidity Risk. Managing Funding and Asset Risk. Segunda Edición. Palgrave. 2014. ISBN 9781137374394

Notación topográfica

Bibliografía Complementaria

1. Duttweiler, Rudolf. Managing Liquidity in Banks. A top down approach. Wiley. 2009 ISBN 978-0-470-74046-0
2. De Lara Haro Alfonso. Medición y Control de riesgos financieros, Editorial Limusa, Tercera edición. 2004. ISBN 968-18-6441-1.

9. Observaciones