



20  
24

**MAESTRÍA EN CIENCIAS EN  
GESTIÓN CUANTITATIVA  
DEL RIESGO FINANCIERO**



**FACULTAD DE  
INGENIERÍA  
ECONÓMICA,  
ESTADÍSTICA Y  
CIENCIAS  
SOCIALES**

**UNIDAD DE POSGRADO**

**EXAMEN DE ADMISIÓN  
MARZO**

**M.Sc. en Gestión  
Cuantitativa del Riesgo  
Financiero**

## PRESENTACIÓN

La maestría realiza una profundización cuantitativa en la gestión del riesgo, considerando en forma paralela la visión gerencial del egresado. La maestría es base para una mención en ingeniería del riesgo financiero.

La maestría presenta las técnicas más avanzadas para la gestión de riesgos, construyendo una base para gestionar instrumentos financieros más complejos que puedan presentarse en el futuro.

Las recomendaciones de regulación financiera de BASILEA para los bancos y SOLVENCIA para las compañías aseguradoras son consideradas a lo largo de la maestría.

---

## PERFIL DEL GRADUADO

Al terminar el MSc el egresado estará capacitado para desarrollar métodos cuantitativos y cualitativos para analizar, detectar y medir los principales riesgos que puedan surgir en una institución, será capaz de aplicar técnicas para mitigar los riesgos financieros.

El alumno que termina la maestría estará capacitado para analizar donde se origina el riesgo y como se propaga, creando modelos innovadores y desarrollando argumentos complejos que involucran técnicas cuantitativas.

De la misma manera al egresado también podrá apreciar y responder a las implicaciones del marco institucional y regulatorio que tienen relación con las prácticas actuales de gestión de riesgos financieros.

---

## OBJETIVOS EDUCACIONALES

El alumno que termina la maestría estará capacitado para:

- Analizar donde se origina el riesgo y como se propaga, creando modelos innovadores y desarrollando argumentos complejos que involucran técnicas cuantitativas.
- Desarrollar habilidades en el manejo de códigos computacionales desarrollados en software libre para el análisis de grandes volúmenes de datos.
- Implementar las principales metodologías de la gestión integral del riesgo financiero (Crédito, Mercado, de Liquidez, del Modelo, Operacional, entre otros con un análisis crítico basado en los fundamentos cualitativos y cuantitativos. proponiendo alternativas de solución para la toma de decisiones.
- Formar analistas cuantitativos capaces de desarrollar modelos matemáticos para la minimización de todo tipo de riesgo.

## VENTAJAS

- Profesores que realizan día a día en sus centros laborales diferentes aplicaciones de acuerdo a la maestría con énfasis en la gerencia del riesgo financiero.
  - Posibilidad de integrar las líneas principales áreas de riesgos e inversiones .
  - Los cursos propuestos hacen de la maestría la mejor opción para aquellos que quieren destacar dentro del sector financiero.
  - La maestría considera conceptos contemporáneos complementados con una orientación a formar gerentes en áreas en la gerencia del riesgo financiero.
  - Prestigio de una universidad de más de 143 años con ventajas comparativas a nivel cuantitativo aplicado y ventajas competitivas a nivel nacional e internacional.
  - Las aplicaciones comienzan desde un nivel inicial hasta un nivel avanzado garantizando el aprendizaje continuo.
- 

## BENEFICIOS

- El alumno que apruebe los 24 créditos académicos (ciclo I y II) la UPG otorga un diploma en Gestión Cuantitativa del Riesgo Financiero a nombre de la Universidad Nacional de Ingeniería.
  - Contar con cursos contemporáneos que resaltan por contar con prestigiosos profesionales con una amplia experiencia.
  - Posibilidad de convalidación de los cursos son Diplomados en Econometría, Finanzas Cuantitativas, programas de especialización, entre otros.
  - Desarrollo de habilidades blandas para la gerencia dentro del sector financiero y afines.
  - Posibilidad de participar en los programas de preparación para obtener las certificaciones internacionales: CFA, FRM, CAIA, CQF, QFRM, QCFA, entre otras.
- 

## LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN

- Riesgos de mercado en instituciones financieras
  - Riesgo de crédito en instituciones financieras
  - Riesgo de balance y liquidez en instituciones financieras
  - Perspectivas cuantitativas del Riesgo Operacional Regulación financiera
  - Otras líneas que serán trabajadas con su asesor de tesis
- 

## MAESTRÍA DIRIGIDA A:

- Gerentes de Riesgos
- Analistas de Senior
- Gerentes Financieros
- Consultores
- Investigadores

# CONTENIDO\*

## CURSOS POR CICLO

### CICLO I

- Estadística Financiera
- Econometría Financiera
- Asset Pricing 1
- Mercados y Productos Financieros
- ERM Enterprise Risk
- Asset Pricing 2



### CICLO II

- Econometría Bancaria
- Cópulas y Aplicaciones
- Gestión de Renta Fija
- Metodología de la investigación
- Gestión de Renta Variable
- Crisis Financieras Internacionales



### CICLO III

- Tesis I: Desarrollo de Tesis como Perfil
- Derivados Financieros
- Gestión de Portafolios
- Riesgo de mercado
- Riesgo de crédito I



### CICLO IV

- Tesis II: Validación de Tesis como Proyecto
- Data Science for Finance and Risk
- Gerencia del Riesgo Financiero
- Riesgo de Crédito II
- Riesgo Operacional
- Riesgo estructurales de balance

\*La Unidad de Posgrado podrá efectuar cambios en la secuencia de los temas de acuerdo a su política de mejora continua.

**NOTA: De no cumplir con el quorum requerido, la Unidad de Posgrado se reserva el derecho de postergar el inicio de clases de la maestría.**

# LABORATORIO DE ALTOS ESTUDIOS FINANCIEROS

El Laboratorio de Altos Estudios Financieros brinda el soporte de la plataforma BLOOMBERG para cada una de las maestrías, adaptando el flujo de información en tiempo real hacia un mejor entendimiento de los mercados, los productos y las interrelaciones entre los agentes económicos



Somos la única universidad pública en contar con el soporte Bloomberg, y uno de los primeros en formar un Laboratorio de Altos Estudios Financieros con terminales Bloomberg.

# INVERSIÓN

## PROCESO DE ADMISIÓN:

### PROSPECTO

S/ 250.00

### DERECHO DE ADMISIÓN

S/ 875.00\*

La evaluación de méritos comprende la entrevista personal virtual y la evaluación del CV. La que corresponde a conocimientos se hará a través de la realización de un ensayo sobre las expectativas del postulante en relación a la maestría y el posible tema que intentará desarrollar como tesis para su grado. El postulante recibirá una guía para poder realizar el ensayo, el cual debe presentarse máximo el 10 de marzo de 2024.



### PREMAESTRÍA 2024-I (Inicio de clases 20 de enero)

Es una de las modalidades de ingreso a la maestría y prepara al postulante para iniciar con éxito su posgrado. **Al alcanzar una vacante, ya no tiene que pagar ni dar el examen de admisión.**

## PROCESO DE INGRESO:

### MATRÍCULA

S/ 656.00

Son cuatro matrículas que se cancelan al inicio de cada ciclo.

### 48 CRÉDITOS DE ENSEÑANZA (4 CICLOS)

S/ 28,800.00

El total son veinticuatro mensualidades.

### DESCUENTOS SOBRE EL MONTO DE CRÉDITOS

8%

Si paga adelantado todo el ciclo

16%

Si paga adelantado toda la maestría

\*El costo por derecho de admisión se realizará un mes después de haber iniciado sus estudios de posgrado.

## REQUISITOS:

- Curriculum vitae simple
- Grado de bachiller o título (en copia y puede ser presentado hasta dentro de 6 meses de haber comenzado la maestría).
- Certificado de estudios universitarios de pregrado (en copia y puede ser presentado hasta dentro de 6 meses de haber comenzado la maestría).
- DNI (copia simple de ambos lados).
- Una foto reciente a color, tamaño carnet, fondo blanco y sin lentes.

## PAGO

Para realizar el pago, deberá de solicitar una orden de pago al correo [info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe](mailto:info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe) o al número +51 913 045 828 indicando su nombre completo, DNI y monto a pagar. En caso desea factura deberá indicar el RUC y los datos de la persona o empresa. Enviar su transferencia o comprobante de pago para considerarlo en la lista de participantes.

Una vez cancelada la orden de pago se le enviará la carpeta, la cual deberá ser llenada y remitida de manera virtual a [info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe](mailto:info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe). [Enlace de carpeta.](#)

## IMPORTANTE

- De no cumplir con el quorum requerido, la Unidad de Posgrado se reserva el derecho de postergar el inicio de clases.
- El reembolso procede con la retención del 15% por gastos administrativos y debe ser justificado. El reembolso o la reserva procede siempre y cuando se solicite antes que inicien las clases.

## INFORMES:



+51 913 045 828  
<https://bit.ly/MRFwspMe>



[info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe](mailto:info.posgrado.fieecs@uni.edu.pe)