

ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS ESG

Objetivo General

Brindar al estudiante una comprensión integral del marco normativo nacional (CNBV, Banxico) e internacional (Basilea) en materia de administración de riesgos y criterios ASG/ESG, que le permita identificar, diseñar, implementar y dar seguimiento a estrategias de mitigación de riesgos, considerando tanto impactos cuantificables como no cuantificables en el contexto organizacional.

Temas y Subtemas

1. Introducción a la normatividad y principios en Administración de Riesgos y Criterios Ambiental, Social y Gobernanza (ASG).
 - 1.1 Riesgos físicos y de transición
 - 1.2 Sostenibilidad y Sustentabilidad.
 - 1.3 Desafíos y oportunidades en la gestión de riesgos y ASG
 - 1.4 Modelos y metodologías para la gestión de riesgos y ASG
2. Identificación y evaluación de riesgos en el marco de la Administración de Riesgos y ASG
 - 2.1 Herramientas para la identificación y evaluación de riesgos
 - 2.2 Análisis de impacto y probabilidad de ocurrencia de riesgos
3. Diseño e implementación de planes de mitigación de riesgos y ASG
 - 3.1 Selección de estrategias y medidas para la mitigación de riesgos
 - 3.2 Gestión de crisis y contingencias
4. Monitoreo y seguimiento de la Administración de Riesgos y ASG
 - 4.1 Indicadores de seguimiento y monitoreo
 - 4.2 Revisión y actualización del plan de gestión de riesgos y ASG



ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS ESG

- 5. La gestión de riesgos en la era de la sostenibilidad
- 5.1 Tendencias y perspectivas en la gestión de riesgos y ASG
- 5.2 Innovaciones tecnológicas para la gestión de riesgos y ASG

- 6. Caso práctico a selección de los alumnos:
- 6.1 Evaluación de riesgos y sostenibilidad en una empresa del sector financiero.
- 6.2 Evaluación de riesgos y sostenibilidad en una empresa de transporte público.
- 6.3 Diseño e implementación de un plan de gestión de riesgos y sostenibilidad en una empresa del sector energético.
- 6.4 Análisis de riesgos y sostenibilidad en una empresa minera.



ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS ESG

Referencias Documentales:

- H1. Basel Committee clarifies how climate-related financial risks may be captured in the existing Basel Framework (2022).
<https://www.bis.org/press/p221208.htm>
- Chong, Y. L., & Chua, Y. H. (2021). Impact of sustainability reporting on environmental risk disclosures in annual reports. *Journal of Cleaner Production*, 288, 125343.
- Demir, E., Özsarı, M. G., & Güneş, E. D. (2021). The impact of environmental, social, and governance (ESG) performance on stock returns: Evidence from Turkey. *Journal of Cleaner Production*, 292, 126057.
- García, M. y Torres, L. (2020). "Administración de Riesgos y ASG". Editorial Trillas.
- García, J. (2021). "Administración de Riesgos y Sostenibilidad: Planificación y Ejecución". Editorial Pearson.
- González, J. (2022). "Riesgos y Sostenibilidad en el Siglo XXI". Editorial Tecnos.
- Huh, S. H., Park, M., & Kim, S. Y. (2021). Sustainability risk management practices of multinational corporations: A case study of a Korean company. *Sustainability*, 13(10), 5680.
- Jain, S. K., & Cuganesan, S. (2021). ESG risks and firm value: evidence from global crisis events. *Journal of Business Research*, 130, 170-180.
- Liu, Y., Li, J., Wu, J., & Lu, W. (2021). Environmental risk management in construction projects based on the fuzzy cognitive map and decision tree model. *Journal of Cleaner Production*, 314, 128126. doi:10.1016/j.jclepro.2021.128126.



ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS ESG

- López, F. (2018). “Gestión de Riesgos y Sostenibilidad”. Editorial McGraw-Hill.
- Pérez, I. (2019). “Evaluación y Seguimiento de Riesgos y Sostenibilidad”. Editorial Limusa
- Principles for the effective management and supervision of climate-related financial risks (2022). <https://www.bis.org/bcbs/publ/d532.htm>
- Ramírez, C. (2019). “Administración de Riesgos y ASG: Conceptos y Aplicaciones”. Editorial Alfaomega.
- Rivera, C. (2021). “Políticas Públicas y Sostenibilidad: Una Aproximación desde la Administración de Riesgos”. Editorial Fondo de Cultura Económica.
- Sánchez, M. (2020). “Administración de Riesgos y ASG: Una Perspectiva Estratégica”. Editorial Prentice Hall.
- Song, X., Wang, Q., Zhang, J., & Zeng, Y. (2021). A stochastic optimization model for ESG investment with tail risk constraints. Journal of Banking & Finance, 129, 106082.
- Taxonomía Sostenible de México. Banxico (2023). 809773.
- Wang, W., Yu, C., Gao, L., & Lu, J. (2021). Integrating sustainability factors in supply chain risk management: A systematic literature review. Journal of Cleaner Production, 315, 128301.



ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS ESG

Criterios de Evaluación

Los métodos de evaluación se diseñarán en función de los contenidos específicos de la asignatura y serán determinados por el docente responsable de su impartición, garantizando su alineación con los objetivos de la unidad de aprendizaje establecidos.

