



FICHA IDENTIFICATIVA

DATOS DE LA ASIGNATURA

Código: 42208
Nombre: Gestión de riesgos
Ciclo: Máster Universitario Oficial
Créditos ECTS: 6
Curso académico: 2025-26

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Facultat d'Economia	1	Anual

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Materias obligatorias	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

CARCHANO ALCINA OSCAR

RESUMEN

-La gestión de riesgos implica evaluar y gestionar, con la ayuda de derivados financieros y otros instrumentos, el grado de exposición de una empresa a distintas fuentes de riesgos.

- En esta asignatura centramos el análisis en el riesgo de mercado, el riesgo de crédito y el riesgo operacional que, de acuerdo con los acuerdos de Basilea II. implican requisitos de capital mínimo para las instituciones financieras. Entre las medidas para la gestión del riesgo de mercado se presta especial atención al Valor en Riesgo (VaR). En lo referente al riesgo de crédito, se analizan las metodologías alternativas en el cálculo de las probabilidades de insolvencia, las medidas de exposición Credit Var y la aplicación de los derivados de crédito. Finalmente, estudiamos las aún poco desarrolladas técnicas de gestión del riesgo operacional.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

**OTROS TIPOS DE REQUISITOS**

Relación con otras asignaturas:

- La asignatura se imparte en el tercer trimestre del primer año.
- Para un seguimiento adecuado de la materia se requiere que el alumno haya cursado la mayor parte de asignaturas que se imparten dentro del primer año del Máster, como Fundamentos de Economía Financiera, Procesos Estocásticos, Cálculo Numérico en Finanzas, Derivados, Gestión Bancaria, y Modelos de Renta Fija.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE**DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS****1. Tema 1. Introducción a la gestión del riesgo****2. Tema 2. Nociones básicas****3. Tema 3. El riesgo de mercado.****4. Tema 4. Riesgo de crédito.****5. Tema 5. El riesgo operacional****VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)****ACTIVIDADES PRESENCIALES**

Actividad	Horas
Teoría	30,00
Prácticas en aula	15,00
Aula informática	15,00
Total horas	60,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES



Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	0,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	0,00

METODOLOGÍA DOCENTE

Clase magistral, prácticas en aula y prácticas con ordenador.

EVALUACIÓN

La evaluación final se realizará con un examen final sobre los contenidos desarrollados en el curso. Complementariamente, se valorará la realización de trabajos individuales y en grupo por parte de los alumnos.

BIBLIOGRAFÍA

- Material de clase en forma de transparencias. Hull J. (2015), Risk Management and Financial Institutions, Wiley Jorion, P. (2007), Value at Risk. The new benchmark for managing financial risk, Third Edition, McGraw-Hill Jorion, P. (2003), Financial Risk Manager Handbook Second Edition, Wiley www.bis.org Otras referencias: Alexander, C. (2001), Market Models: A Guide to Financial Data Analysis, Wiley Crouhy, M., D. Galai y R. Mark (2006), The essentials of risk management, McGraw-Hill Hull J. (2015), Options, Futures, and Other Derivatives, Pearson Lando (2004), Credit Risk Modeling: Theory and Applications, Princeton Schönbucher, Philipp J. (2003) Credit derivatives pricing models, Wiley