



FITXA IDENTIFICATIVA

DADES DE L'ASSIGNATURA

Codi: 42208

Nom: Gestió de riscos

Cicle: Màster Universitari Oficial

Crèdits ECTS: 6

Curs acadèmic: 2025-26

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	1	Anual

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Matèries obligatòries	OBLIGATÒRIA

COORDINACIÓ

TORRO I ENGUIX HIPOLIT

RESUM

La gestió de riscos implica avaluar i gestionar, amb l'ajuda de derivats financers i altres instruments, el grau d'exposició d'una empresa a diferents fonts de riscos.

- En aquesta assignatura centrem l'anàlisi en el risc de mercat, el risc de crèdit i el risc operacional que, d'acord amb els acords de Basilea II. impliquen requisits de capital mínim per a les institucions financeres. Entre les mesures per a la gestió del risc de mercat es presta especial atenció a la Valor en Risc (VaR). Pel que fa al risc de crèdit, s'analitzen les metodologies alternatives en el càlcul de les probabilitats d'insolvència, les mesures d'exposició Credit Var i l'aplicació dels derivats de crèdit. Finalment, estudiem les encara poc desenvolupades tècniques de gestió del risc operacional

CONEIXEMENTS PREVIS

RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS



Relació amb altres assignatures:

- L'assignatura s'imparteix en el tercer trimestre del primer any.
- Per a un seguiment adequat de la matèria es requereix que l'alumne hagi cursat la major part d'assignatures que s'imparteixen dins el primer any del màster, com Fonaments d'Economia Financera, Processos Estocàstics, Càlcul Numèric en Finances, Derivats, Gestió Bancària, i Models de renda fixa.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Tema 1. Introducció a la gestió del risc

2. Tema 2. Nocions bàsiques

Introducció a la gestió de riscos

3. Tema 3. El risc de mercat.

4. Tema 4. Risc de crèdit.

5. Tema 5. El risc operacional

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	15,00
Aula informàtica	15,00



Total hores	60,00
--------------------	--------------

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	0,00
Preparació de classes	0,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	0,00

METODOLOGIA DOCENT

Classe magistral, pràctiques en aula i pràctiques amb ordinador.

AVALUACIÓ

L'avaluació final es realitzarà amb un examen final sobre els continguts desenrotllats en el curs. Complementàriament, es valorarà la realització de treballs individuals i en grup per part dels alumnes.

BIBLIOGRAFIA

- Material de classe en forma de transparencies. 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