



Guía Docente				
Datos Identificativos				2014/15
Asignatura (*)	Análise e xestión de riscos	Código	611448004	
Titulación				
Descritores				
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Obrigatoria	4
Idioma	Castelán			
Prerrequisitos				
Departamento	Economía Financeira e Contabilidade			
Coordinación	Rodríguez Lopez, Manuel	Correo electrónico	marod@udc.es	
Profesorado	Alvarez Garcia, Begoña Miñones Crespo, Ramon Rodríguez Lopez, Manuel	Correo electrónico	begona.alvarez@udc.es ramon.minones@udc.es marod@udc.es	
Web				
Descrición xeral	Estudio de los principales tipos de riesgos que afectan a las actividades del sector financiero			

Competencias da titulación	
Código	Competencias da titulación

Resultados da aprendizaxe		
Competencias de materia (Resultados de aprendizaxe)	Competencias da titulación	
Habilidades para percibi-las fontes de risco financiero	BP2 BP5 BP6 BP11 BP13 BP14 BP15 BP16 BP17 BP18 BP19 BP20 BP21 BP22 BP23	
Explotación de datos financeiros e de mercado na análise e avaliación de riscos	BP2 BP3 BP4 BP8 BP11 BP13 BP24 BP25 BP26 BP27 BP28	CM3



Habilidades no emprego de recursos informáticos e baseados nas TIC		BP3 BP4 BP14	CM3
Capacidade de aprendizaxe continua e autónoma utilizando a autoevaluación		BP7 BP11 BP13	CM7
Elaboración de diagnósticos financeiros críticos y racionais		BP12 BP13	CM6

Contidos	
Temas	Subtemas
Introducción	O risco na empresa Riscos financeiros
Risco de interese	Tipos de interese: concepto e clasificación A estrutura temporal dos tipos de interese: utilidade e estimación Xestión do risco: duration, convexidade e inmunización
Risco de mercado	Factores de risco de mercado Medición do risco de mercado
Risco de liquidez	Medición do risco de liquidez Control do risco de liquidez Estratexias de Xestión do risco de liquidez
Risco de creto	Predicción de insolvencia Modelos estruturales
Risco operacional	Concepto Metodoloxías de xestión Estimación de capital
Xestión global do risco: estratexias para a xestión integral do risco	Aspectos organizativos da función de Xestión de Riscos na empresa Estudio de casos de Xestión de Riscos en diferentes sectores

Planificación			
Metodoloxías / probas	Horas presenciais	Horas non presenciais / traballo autónomo	Horas totais
Estudo de casos	7	15.05	22.05
Presentación oral	6	11.4	17.4
Aprendizaxe colaborativa	7	15.05	22.05
Sesión maxistral	12	25.5	37.5
Atención personalizada	1	0	1

\*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías	
Metodoloxías	Descrición
Estudo de casos	Análise de casos reais
Presentación oral	Exposición e defensa por parte do alumno de temática da asignatura
Aprendizaxe colaborativa	Resolución de tarefas de maneira guiada por el profesor apoyado
Sesión maxistral	Exposición de temas e coordinación do traballo de forma individual e en grupo

Atención personalizada	
Metodoloxías	Descrición



Estudo de casos Aprendizaxe colaborativa	Axudar o tratamento de problemas na preparación dos temas e na resolución de exercicios con ferramentas informáticas
--	--

Avaliación		
Metodoloxías	Descrición	Cualificación
Estudo de casos	Calidade dos traballos, coherencia das análises	41
Presentación oral	Calidade da presentación e a defensa realizadas	18
Aprendizaxe colaborativa		41

Observacións avaliación
O exame da segunda oportunidade constará unicamente dunha proba mixta a que asignarase o 100% da calificación.

Fontes de información	
<b>Bibliografía básica</b>	<ul style="list-style-type: none"><li>- Meneu, V.; Navarro, E.; Barreira, M.T. (1992). Análisis y gestión del riesgo de interés. Barcelona</li><li>- Ferruz Agudo, L. (2001). Dirección financiera del riesgo de interés. Madrid</li><li>- Feria, J. M. (2005). El riesgo de mercado. Su medición y control. Madrid</li><li>- Lam, James (2003). Enterprise Risk Management: From Incentives to Controls . Hoboken, New Jersey: John Wiley &amp; Sons</li><li>- Saunders, A.; Cornett, M. (2006). Financial Institutions Management. A Risk Management Approach. New York</li><li>- Batten, J.; Fetherson, T. (2002). Financial Risk and Financial Risk Management. Oxford</li><li>- Doldán Tié, Félix R. (2009). Riesgos Financieros. La Coruña</li><li>- Cox, L. (2002). Risk Analysis. Foundations, Models and Methods. Massachusetts</li><li>- Jorion, P. (1997). Valor en riesgo. México</li></ul>
<b>Bibliografía complementaria</b>	

Recomendacións
<b>Materias que se recomenda ter cursado previamente</b>
<b>Materias que se recomenda cursar simultaneamente</b>
<b>Materias que continúan o temario</b>
<b>Observacións</b>

(\*)A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías