



## Guía Docente

Datos Identificativos					2019/20
Asignatura (*)	Análise e xestión de riscos		Código	611448004	
Titulación					
Descritores					
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos	
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Obrigatoria	4	
Idioma	Castelán				
Modalidade docente	Presencial				
Prerrequisitos					
Departamento	Empresa				
Coordinación	Rodriguez Lopez, Manuel	Correo electrónico	marod@udc.es		
Profesorado	Alvarez Garcia, Begoña Miñones Crespo, Ramon Rodriguez Lopez, Manuel	Correo electrónico	begona.alvarez@udc.es ramon.minones@udc.es marod@udc.es		
Web	moodle.udc.es				
Descrición xeral	Estudo dos principais tipos de riscos que afectan as actividades do sector financeiro.				

## Competencias do título

Código	Competencias do título
--------	------------------------

## Resultados da aprendizaxe

Resultados de aprendizaxe	Competencias do título		
Habilidades para percibi-las fontes de risco financeiro.	AP19 AP20	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.	AP19 AP20	BP2 BP3 BP4 BP8 BP11 BP13 BP24 BP25 BP26 BP27 BP28	CM3



Habilidades no emprego de recursos informáticos e baseados nas TIC.	BP3 BP4 BP7 BP10 BP14	CM3 CM6
Capacidade de aprendizaxe continua e autónoma utilizando a autoevaluación.	BP7 BP9 BP10 BP11 BP12 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	Competencias	Horas presenciais	Horas non presenciais / traballo autónomo	Horas totais
Estudo de casos	A19 A20 B2 B3 B4 B5 B6 B7 B8 B9 B10 B11 B12 B14 B15 B16 B17 B18 B19 B20 B22 B23 B24 B25 B26 B28 C3 C6	5	12.5	17.5
Aprendizaxe colaborativa	B10 B11 B12 B13 B15 B17 B19 B21 B22 B23 B24 B25 B26 B27 B28 C3 C6 C7	9	22.5	31.5



Proba mixta	A19 A20 B2 B3 B5 B6 B8 B9 B12 B13 B15 B16 B17 B18 B19 B24 B25 B26 B27 B28	2	6	8
Sesión maxistral	A19 A20 B2 B6 B11 B12 B14 B15 B16 B17 B18 B19 B20 B21 B22 B23 B24 B25 B26 B28 C7	12	30	42
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
Aprendizaxe colaborativa	Resolución de tarefas de maneira guiada apoiado polo profesor
Proba mixta	Resolución de problemas
Sesión maxistral	Exposición de temas e coordinación do traballo de forma individual e en grupo

Atención personalizada	
Metodoloxías	Descrición
Estudo de casos Aprendizaxe colaborativa	O alumno dispón das tutorías dos profesores da materia para a aclaración das dúbidas que se lle presenten na resolución de casos, preparación de presentacións ou calquera outra relativa á materia da materia.  Axudar o tratamento de problemas na preparación dos temas e na resolución de exercicios con ferramentas informáticas, tanto no caso dos alumnos matriculados en réxime de dedicación a tempo completo como no caso de alumnos con recoñecemento de dedicación a tempo parcial.

Avaliación			
Metodoloxías	Competencias	Descrición	Cualificación
Estudo de casos	A19 A20 B2 B3 B4 B5 B6 B7 B8 B9 B10 B11 B12 B14 B15 B16 B17 B18 B19 B20 B22 B23 B24 B25 B26 B28 C3 C6	Calidade dos traballos, coherencia das análises	47
Proba mixta	A19 A20 B2 B3 B5 B6 B8 B9 B12 B13 B15 B16 B17 B18 B19 B24 B25 B26 B27 B28	Calidad del trabajo realizado	33
Aprendizaxe colaborativa	B10 B11 B12 B13 B15 B17 B19 B21 B22 B23 B24 B25 B26 B27 B28 C3 C6 C7	Calidad del trabajo realizado	20



## Observacións avaliación

Os alumnos teñen que aprobar a parte da materia que imparte cada profesor.

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

Estes criterios de avaliación son os mesmos para os alumnos matriculados en réxime de dedicación a tempo completo e para os alumnos con recoñecemento de dedicación a tempo parcial.

En la evaluación continua de la asignatura, será requisito indispensable evaluar la asistencia regular, con participación activa y aprovechamiento, a las sesiones y actividades organizadas por los coordinadores de la asignatura y el Máster.

La calificación de no presentado se aplicará al alumnado que solo participa en actividades de evaluación que tienen un peso inferior al 20% en la calificación final, independientemente de la puntuación obtenida.

## Fontes de información

### Bibliografía básica

- Batten, J.; Fetherson, T. (2002). Financial Risk and Financial Risk Management. Oxford
  - Cox, L. (2002). Risk Analysis. Foundations, Models and Methods. Massachusetts
  - Doldán Tié, Félix R. (2009). Riesgos Financieros. La Coruña
  - Feria, J. M. (2005). El riesgo de mercado. Su medición y control. Madrid
  - Ferruz Agudo, L. (2001). Dirección financiera del riesgo de interés. Madrid
  - Meneu, V.; Navarro, E.; Barreira, M.T. (1992). Análisis y gestión del riesgo de interés. Barcelona
  - Jorion, P. (1997). Valor en riesgo. México
  - Lam, James (2003). Enterprise Risk Management: From Incentives to Controls . Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons
  - Saunders, A.; Cornett, M. (2006). Financial Institutions Management. A Risk Management Approach. New York
- No Moodle da materia poderán deixarse ligazóns ou bibliografía adicional para os distintos temas da materia.

### Bibliografía complementaria

## Recomendacións

**Materias que se recomenda ter cursado previamente**

**Materias que se recomenda cursar simultaneamente**

**Materias que continúan o temario**

## Observacións

(\*)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 de acordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías