



## Guía Docente

Datos Identificativos					2023/24
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	campusvirtual.udc.es				
Descrición xeral	Estudo dos principais tipos de riscos que afectan as actividades do sector financeiro.				

## Competencias / Resultados do título

Código	Competencias / Resultados do título
--------	-------------------------------------

## Resultados da aprendizaxe

Resultados de aprendizaxe	Competencias / Resultados 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 / Resultados	Horas lectivas (presenciais e virtuais)	Horas 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 profesorado
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 alumnado dispón das titorías do profesorado 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 do alumnado matriculado en réxime de dedicación a tempo completo como no caso do alumnado con recoñecemento de dedicación a tempo parcial.

Avaliación			
Metodoloxías	Competencias / Resultados	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	Calidade do traballo realizado	33
Aprendizaxe colaborativa	B10 B11 B12 B13 B15 B17 B19 B21 B22 B23 B24 B25 B26 B27 B28 C3 C6 C7	Calidade do traballo realizado	20



## Observacións avaliación

### A) NORMATIVA DE AVALIACIÓN:

1. Condicións de avaliación: Está prohibido acceder á aula do exame con calquera dispositivo que permita a comunicación co exterior e/ou almacenamento de información. A realización fraudulenta das probas ou actividades de avaliación, unha vez comprobada, implicará directamente a cualificación de suspenso na convocatoria en que se cometa: corresponderá unha cualificación de "suspenso" (nota numérica 0) na convocatoria correspondente do curso académico, tanto se a comisión da falta se produce na primeira oportunidade coma na segunda. Para isto, procederase a modificar a cualificación na acta de primeira oportunidade, se fose necesario.
2. Identificación: O alumnado ha de acreditar a súa personalidade de acordo coa normativa vixente.

### B) TIPOS DE CUALIFICACIÓN:

1. Cualificación de non presentado: Cando só participe en actividades de avaliación que teñan unha ponderación inferior ao 20% sobre a cualificación final, con independencia da cualificación alcanzada.
2. Recoñecemento de dedicación a tempo parcial e dispensa académica de exención de asistencia: O estudantado con recoñecemento de dedicación a tempo parcial será avaliado cos mesmos criterios que o alumnado a tempo completo.

### C) OPORTUNIDADES DE AVALIACIÓN:

A materia estrutúrase en tres partes. Para aprobar a materia o alumnado ten que aprobar a parte da materia que imparte cada docente.

Para aprobar a materia é requisito necesario a asistencia a un 80% das sesións de clase, con aproveitamento e participación activa.

1. Primeira oportunidade: aplicaranse os criterios de avaliación pertinentes indicados anteriormente nesta sección.
2. Segunda oportunidade: constará unicamente dunha proba mixta correspondente á materia pendente da asignatura non superada na primeira oportunidade da convocatoria.
3. Convocatoria adiantada: Será avaliada por medio dunha proba mixta que suporá o 100 % da cualificación final, que comprenda todos os contidos e competencias da materia.

## 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. Massachusettis
  - Doldán Tié, Félix R. (2009). Riesgos Financieros. La Coruña
  - Fera, 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

