

## FICHA TÉCNICA DE LA ASIGNATURA

Datos de la asignatura	
Nombre	Laboratorio de riesgo
Titulación	Máster Universitario en Gestión de Riesgos Financieros
Cuatrimestre	2º
Créditos ECTS	4
Carácter	Optativa
Coordinador	Íñigo de Oñate Rodríguez de la Borbolla

Datos del profesorado	
Profesor	
Nombre	Álvaro María Chamizo Cana
Departamento	ICADE Business School
e-mail	albaroch@yahoo.es
Nombre	Antonio Mota Pizarro
Departamento	ICADE Business School
e-mail	amota@comillas.edu
Nombre	Íñigo de Oñate Rodríguez de la Borbolla
Departamento	ICADE Business School
e-mail	ionate.bce@cajarural.com

## DATOS ESPECÍFICOS DE LA ASIGNATURA

Contextualización de la asignatura
Aportación al perfil profesional de la titulación
<p>La asignatura ofrece al alumno de una visión aplicada de la práctica profesional de la gestión de riesgos.</p> <p>Por estar centrada en casos prácticos de la gestión de riesgos, contextualiza de un modo realista la formación en las competencias que serán necesarias en el ejercicio profesional.</p>

## BLOQUES TEMÁTICOS Y CONTENIDOS

Contenidos – Bloques Temáticos
<b>GESTIÓN DEL RIESGO DE MERCADO EN POSICIONES DE TESORERÍA:</b> Diseño de la estrategia de cobertura del riesgo de mercado mediante futuros de tipos de interés e IRS's.
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Valoración de Renta Fija, concretamente bonos del tesoro.</li> <li>- Estimación de curva de tipos implícitos mediante técnicas de bootstrapping.</li> <li>- Análisis de correlación entre curvas de tipos de interés.</li> <li>- Valoración de futuros de tipos de interés</li> <li>- Valoración de IRS's</li> <li>- Pros y contras de ambas coberturas.</li> </ul>
<b>EJERCICIO PRÁCTICO SOBRE INTEGRACIÓN DE MODELOS DE RIESGO DE CRÉDITO EN LA GESTIÓN</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Conceptos básicos</li> <li>- Caso práctico para Banca Minorista</li> </ul>
<b>DIAGNÓSTICO Y ADECUACIÓN ESTRATÉGICA DEL NIVEL DE CAPITALIZACIÓN DE UNA ENTIDAD</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Aspectos metodológicos. Herramienta de planificación y evaluación del capital</li> <li>- Aplicación práctica</li> </ul>
<b>CASO PRÁCTICO DE RIESGO DE CRÉDITO PARA BANCA MAYORISTA</b>

## COMPETENCIAS

Competencias - Objetivos
<b>Instrumentales</b>
CGI1 Capacidad de análisis y síntesis CGI2 Resolución de problemas y toma de decisiones CGI4 Capacidad de gestionar información proveniente de fuentes diversas CGI5 Conocimientos avanzados de informática relativos al ámbito de estudio
<b>Personales</b>
CGP1 Habilidades Interpersonales: escucha, debate y argumentación CGP3 Capacidad crítica y autocrítica
<b>Sistémicas</b>
CGS1 Capacidad para aprender y trabajar autónomamente CGS2 Capacidad de adaptación al cambio CGS3 Capacidad de iniciativa y espíritu emprendedor CGS4 Capacidad de elaboración y transmisión de ideas, proyectos, informes soluciones y problemas CGS5 Orientación a la acción y a la calidad

## METODOLOGÍA DOCENTE

Aspectos metodológicos generales de la asignatura	
<b>Metodología Presencial: Actividades</b>	<b>Competencias</b>
<p>La asignatura se apoya en el método del caso.</p> <p>Los profesores plantearán a los alumnos casos prácticos que podrían presentarse en su vida profesional, para lo cual aplican la metodología estudiada en el resto de asignaturas y explican aquellas metodologías complementarias que resulten necesarias.</p>	<p>Se trabajan las competencias enunciadas en un contexto que simula el ejercicio profesional</p>
<b>Metodología No presencial: Actividades</b>	<b>Competencias</b>
<p><b>Revisión de las metodologías necesarias en los casos prácticos:</b> Tanto la revisión de aquellas explicadas en asignaturas previas, como las que explique el profesor en el aula</p> <p><b>Preparación de ejercicios y prácticas:</b> El alumno tiene que tratar de resolver las prácticas que el profesor le indique.</p>	<p>Se trabajan las competencias enunciadas en un contexto que simula el ejercicio profesional</p>

## EVALUACIÓN Y CRITERIOS DE CALIFICACIÓN

Actividades de evaluación	CRITERIOS	PESO
Resolución de caso práctico sobre gestión del riesgo de mercado en posiciones de tesorería	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Comprende la metodología necesaria</li> <li>- Aplica correctamente los conceptos estudiados a resolver los problemas</li> </ul>	30%
Trabajo sobre diagnóstico y adecuación estratégica del nivel de capitalización o evaluación de modelos de riesgo de crédito en la gestión	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Comprende los conceptos y la metodología necesaria</li> <li>- Aplica correctamente los conceptos estudiados a resolver los problemas</li> </ul>	45%
Examen práctico sobre riesgo de crédito para banca minorista	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Comprende la metodología necesaria</li> <li>- Aplica correctamente los conceptos estudiados a resolver los problemas</li> <li>Identifica los errores a partir de la corrección en el aula</li> </ul>	25%

## BIBLIOGRAFÍA Y RECURSOS

<b>Bibliografía</b>
<b>Bibliografía Básica</b>
<b>Libros de texto</b>
Hull, J. C. (2012) Risk management and financial institutions. Hoboken: John Wiley & Sons Hull, J. C. (2012) Options, Futures, and Other Derivatives. New York: Pearson Prentice Hall