

## 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	Francisco Javier Arizmendi Carlin
Departamento	ICADE Business School
e-mail	fjarizmendi@gmail.com
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@movistar.es

## DATOS ESPECÍFICOS DE LA ASIGNATURA

Contextualización de la asignatura
<b>Aportación al perfil profesional de la titulación</b>
La asignatura ofrece al alumno de una visión aplicada de la práctica profesional de la gestión de riesgos.
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.

## BLOQUES TEMÁTICOS Y CONTENIDOS

<b>Contenidos - Bloques Temáticos</b>	
<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>- Estrategia de cobertura de instrumentos de renta fija con futuro de tipos de interés.</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>CAPITAL ECONÓMICO Y RORAC</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Metodología de cálculo. Capital Económico, Riesgo y Asignación contable.</li> <li>- Ejercicios y aplicación práctica.</li> </ul>	
<b>CASO PRÁCTICO DE RIESGO DE CRÉDITO PARA BANCA MAYORISTA</b>	

## COMPETENCIAS

<b>Competencias - Objetivos</b>	
<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	

## TODOLOGÍA DOCENTE

<b>Aspectos metodológicos generales de la asignatura</b>	
<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	<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>	30%
Resolución de caso práctico sobre capital económico y RORAC	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Comprende la metodología necesaria</li> <li>- Aplica correctamente los conceptos estudiados a resolver los problemas</li> </ul>	20%
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>	20%

## 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