



FICHA TÉCNICA DE LA ASIGNATURA

Datos de la asignatura	
Nombre completo	Gestión Cuantitativa del Riesgo / Quantitative Risk Management
Código	E000012216
Título	Máster Universitario en Finanzas por la Universidad Pontificia Comillas
Impartido en	Máster Universitario en Finanzas / Master in Finance [Primer Curso]
Créditos	3,0 ECTS
Carácter	Optativa
Departamento / Área	Avantere School of Management

Datos del profesorado	
Profesor	
Nombre	José Pedro Nicolás Delettieres
Correo electrónico	jnicolas@comillas.edu

DATOS ESPECÍFICOS DE LA ASIGNATURA

Contextualización de la asignatura

Competencias - Objetivos	
Competencias	
GENERALES	
CG01	Aprendizaje por proyectos: Capacidad para desarrollar y ejecutar en sus distintas fases proyectos financieros colectivos basados situaciones reales, proponiendo soluciones reales y haciendo eficientes todas las interacciones con el equipo, clientes y cualquier otro participante
CG03	Trabajo en equipo: Aplicar técnicas y metodologías que promuevan el trabajo en equipos y la colaboración y coordinación mutua en proyectos financieros a realizar con empresas y organizaciones
CG09	Competencia digital: Emplear, aprovechar y utilizar, de manera eficiente y segura, los recursos tecnológicos y digitales que se aplican en la gestión financiera de las organizaciones
CG10	Capacidad Técnica: Capacidad de análisis, síntesis, y proyección, aplicadas a situaciones, problemas y modelos, en el ámbito financiero
ESPECÍFICAS	
CE04	Dominar las distintas técnicas de valoración y modelización de activos derivados y contextualizarlos dentro de la gestión avanzada de carteras de inversión reales



CE05	Conocer en profundidad las nuevas actividades empresariales dentro del sector financiero, así como los procesos de generación de valor basados en las nuevas tecnologías y su impacto en el ecosistema financiero actual y futuro
CE08	Conocer en profundidad el funcionamiento y los sistemas de gestión de las entidades de crédito dentro del paradigma financiero actual, así como otras fuentes financiación alternativa, los distintos productos de crédito bancario y no bancario y soluciones que ofrecen los mercados de financiación a distintos proyectos de financiación
CE10	Saber identificar los principales riesgos financieros y no financieros a los que se enfrenta cualquier empresa, y aplicar modelos avanzados para su control y gestión
ESPECÍFICAS DE OPTATIVIDAD	
CEOPT02	Conocer y aplicar las técnicas de modelización y de analítica de datos para estimar el comportamiento del inversor y/o los mercados, así como crear estrategias y modelos de gestión de riesgos de inversiones, y cómo la inteligencia artificial, la automatización de procesos y el aprendizaje automático, permiten optimizar esos procesos y hacerlos más eficientes

BLOQUES TEMÁTICOS Y CONTENIDOS

METODOLOGÍA DOCENTE

Aspectos metodológicos generales de la asignatura

RESUMEN HORAS DE TRABAJO DEL ALUMNO

HORAS PRESENCIALES
HORAS NO PRESENCIALES
CRÉDITOS ECTS: 3,0 (0 horas)

EVALUACIÓN Y CRITERIOS DE CALIFICACIÓN

BIBLIOGRAFÍA Y RECURSOS