

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	42208
Nom	Gestió de riscos
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2022 - 2023

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	Facultat d'Economia	1	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	1 - Matèries obligatòries	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economia Financera i Actuarial

RESUM

La gestió de riscos implica avaluar i gestionar, amb l'ajuda de derivats financers i altres instruments, el grau d'exposició d'una empresa a diferents fonts de riscos.

- En aquesta assignatura centrem l'anàlisi en el risc de mercat, el risc de crèdit i el risc operacional que, d'acord amb els acords de Basilea II. impliquen requisits de capital mínim per a les institucions financeres. Entre les mesures per a la gestió del risc de mercat es presta especial atenció a la Valor en Risc (VaR). Pel que fa al risc de crèdit, s'analitzen les metodologies alternatives en el càlcul de les probabilitats d'insolvència, les mesures d'exposició Credit Var i l'aplicació dels derivats de crèdit. Finalment, estudiem les encara poc desenvolupades tècniques de gestió del risc operacional



CONEIXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

Relació amb altres assignatures:

- L'assignatura s'imparteix en el tercer trimestre del primer any.
- Per a un seguiment adequat de la matèria es requereix que l'alumne hagi cursat la major part d'assignatures que s'imparteixen dins el primer any del màster, com Fonaments d'Economia Financera, Processos Estocàstics, Càlcul Numèric en Finances, Derivats, Gestió Bancària, i Models de renda fixa.

COMPETÈNCIES

RESULTATS DE L'APRENTATGE

Aquesta matèria es desenvolupa durant un total de 60 hores presencials, de les quals la meitat corresponen a classes pràctiques. Al seu torn, les hores de classes pràctiques es reparteixen en parts iguals entre l'aula tradicional i l'aula d'ordinadors.

- Per a un seguiment adequat de la matèria es requereix que l'alumne hagi cursat la major part d'assignatures que s'imparteixen dins el primer any de Màster, com Fonaments d'Economia Financera. Processos Estocàstics. Càlcul Numèric en Finances. Derivats. Gestió Bancària. i Models de renda fixa. Per tant, la seqüència d'assignatures en aquest primer any és plenament coherent amb les necessitats de l'assignatura.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Tema 1. Introducció a la gestió del risc

2. Tema 2. Nocions bàsiques

Introducció a la gesgió de riscos

**3. Tema 3. El risc de mercat.****4. Tema 4. Risc de crèdit.****5. Tema 5. El risc operacional****VOLUM DE TREBALL**

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	30,00	100
Pràctiques en aula informàtica	15,00	100
Pràctiques en aula	15,00	100
TOTAL	60,00	

METODOLOGIA DOCENT

Classe magistral, pràctiques en aula i pràctiques amb ordinador.

AVALUACIÓ

L'avaluació final es realitzarà amb un examen final sobre els continguts desenrotllats en el curs. Complementàriament, es valorarà la realització de treballs individuals i en grup per part dels alumnes.

REFERÈNCIES**Bàsiques**

- Material de classe en forma de transparencies.
- Hull J. (2015), Risk Management and Financial Institutions, Wiley
- Jorion, P. (2007), Value at Risk. The new benchmark for managing financial risk, Third Edition, McGraw-Hill
- Jorion, P. (2003), Financial Risk Manager Handbook Second Edition, Wiley
- www.bis.org

Otras referencias:

- Alexander, C. (2001), Market Models: A Guide to Financial Data Analysis, Wiley
- Crouhy, M., D. Galai y R. Mark (2006), The essentials of risk management, McGraw-Hill
- Hull J. (2015), Options, Futures, and Other Derivatives, Pearson
- Lando (2004), Credit Risk Modeling: Theory and Applications, Princeton



Schönbucher, Philipp J. (2003) Credit derivatives pricing models, Wiley

