



DENOMINACIÓN ASIGNATURA: GESTION DE RIESGOS FINANCIEROS		
GRADO: FINANZAS Y CONTABILIDAD	CURSO: 3º	CUATRIMESTRE: 2

PLANIFICACIÓN SEMANAL DE LA ASIGNATURA								
SEMANA	SESIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (marcar X)		Indicar espacio distinto de aula (aula informática, audiovisual, etc.)	TRABAJO SEMANAL DEL ALUMNO		
			GRANDE Lunes	PEQUEÑO Viernes		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESENCIALES	HORAS TRABAJO (Max. 7h semana)
1	1	Necesidad de la Gestión de Riesgos. Tipos de Riesgos	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5	
1	2	Modelización de la Volatilidad con datos reales		X	(infor)	Trabajo con el programa Excel con datos facilitados. CONSULTAR AULA INFORMATICA. SE PUEDE TRAER PORTATILES CON EXCEL	1,5	
2	3	La Técnica de la Cobertura	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5	
2	4	Hoja de Ejercicios (I)		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de	1,5	

						autoevaluación planteadas.	
3	5	Las Griegas Y Seguro de Cartera	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
3	6	Hoja de Ejercicios (II)		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
4	7	Gestión del Riesgo de Interés	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
4	8	Hoja de Ejercicios (III)		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
5	9	El Concepto de Valor en Riesgo (VaR)	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
5	10	Hoja de Ejercicios (IV)		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
6	11	Enfoque Paramétrico pVar y VaR beta	X			Trabajo con el programa Excel con datos facilitados. Planteamiento y Realización del caso práctico.	1,5
6	12	Practicas Excel pVaR y Var beta		X	(9 –Mar)	CONSULTAR AULA INFORMATICA. SE PUEDE TRAER PORTATILES CON EXCEL	1,5
7	13	VaR por Simulación	X			Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
7	14	Examen: Prueba Evaluación Continua				Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5
8	15	Backtesting de los Modelos VaR	X			Trabajo con el programa Excel con datos facilitados. Planteamiento y Realización del caso práctico.	1,5
8	16	Practica en Excel Simulación Histórica y Montecarlo		X	(23-mar)	CONSULTAR AULA INFORMATICA. SE PUEDE TRAER PORTATILES CON EXCEL	1,5
9	17	CORRECCION	X				1,5

9	18	Practica de Backtesting en Excel		X	(6 ABR)	CONSULTAR AULA INFORMATICA. SE PUEDE TRAER PORTATILES CON EXCEL	1,5	
10	19	Var para Derivados	X			Preparación del caso práctico	1,5	
10	20	Definición CASO / TRABAJO		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5	
11	21	Medidas Coherentes de Riesgo y descomposición VaR	X			Trabajo con el programa Excel con datos facilitados. Planteamiento y Realización del caso práctico.	1,5	
11	22	Hoja de ejercicios (V) y Tutorías Trabajo		X		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5	
12	23	Acuerdos de Basilea (de BIS I a BIS III)	X			Trabajo con el programa Excel con datos facilitados. Planteamiento y Realización del caso práctico.	1,5	
12	24	Hoja de Ejercicios (VI)		x		Estudio de notas de clase y de bibliografía básica. Respuesta a preguntas de autoevaluación planteadas.	1,5	
13	25	Presentación trabajos		X			1,5	
13	26	Presentación trabajos	X				1,5	
14	27	Presentación trabajos		X			1,5	

Subtotal 1

42

Total 1 (Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 1-14)

15		Recuperaciones, tutorías, entrega de trabajos, etc						
16		Preparación de evaluación y evaluación					3	
17								
18								

Subtotal 2

3

Total 2 (Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 15-18)

TOTAL (<i>Total 1 + Total 2</i>)

150
