

El curso se divide en los siguientes siete capítulos:

Capítulo 1. Gestión del riesgo y valor de la empresa.

- En este capítulo se analiza el concepto de riesgo, el proceso de gestión del riesgo, los mecanismos de creación de valor y los efectos de la diversificación.

Capítulo 2. Gestión del riesgo con Forwards y Swaps.

- en este capítulo se analizan las estrategias de cobertura del riesgo de divisas y de tipos de interés mediante coberturas naturales y coberturas financieras con forwards y swaps.

Capítulo 3. Gestión del riesgo con futuros y opciones.

- En este capítulo se analizan las estrategias de cobertura del riesgo de los activos financieros mediante el uso de futuros y opciones financieros.

Capítulo 4. Las griegas.

- En este capítulo se analizan estrategias de cobertura simples y complejas para opciones.

Capítulo 5. Riesgo de mercado.

- Principales características. Cómo medir el riesgo de mercado de una cartera de acciones. El valor en riesgo (VaR) como sustituto del riesgo de mercado.

Capítulo 6. Medición del riesgo de crédito.

- Este capítulo presenta los principales enfoques para evaluar el riesgo de crédito. También presenta las propuestas de modelos estándar de la literatura.

Capítulo 7. Derivados de crédito.

- Este capítulo presenta las principales características de los derivados diseñados para la cobertura del riesgo de impago.