

MASTER		Master Universitario en Instituciones y Mercados Financieros
ASIGNATURA	TECNICAS CUANTITATIVAS PARA LA MODELIZACIÓN Y CONTROL DEL RIESGO EMPRESARIAL	
Nº de ECTS	3	
Nº de horas docentes	22,5	
Nº de horas actividades académicas dirigidas	52,5	
Profesor responsable de la asignatura	RICARDO QUERALT	
Curso académico	2018/2019	
Cuatrimestre	1ER CUATRIMESTRE	
Horario lectivo	La coordinación del programa máster fijará el horario de docencia en colaboración con el profesor	

1.- DESCRIPCIÓN GENERAL DE LA ASIGNATURA Y OBJETIVOS DE DOCENCIA:

La asignatura tiene como objetivo que los alumnos adquieran los conocimientos necesarios sobre las herramientas y técnicas cuantitativas para la modelización y control del riesgo empresarial. Se complementaran aspectos técnicos con ejercicios prácticos elaborados con datos reales utilizando Hojas de Cálculo y software especializado.

2.- FORMA DE EVALUACIÓN PREVISTA:

2.1.- Convocatoria Ordinaria:

Participación y asistencia	10%
Prueba parcial	No hay.
Actividades Académicas dirigidas	<ul style="list-style-type: none"> – Casos prácticos, supuestos,... 20% – Presentaciones individuales o en equipo 10%
Prueba objetiva final	60%

2.2.- Convocatoria Extraordinaria

La calificación obtenida durante el curso correspondiente a la participación y asistencia, la prueba parcial y las actividades académicas dirigidas se aplica a la convocatoria extraordinaria con la misma ponderación. El resto de la puntuación en la convocatoria extraordinaria vendrá dado por la prueba objetiva final (convocatoria extraordinaria) propuesta por el profesor para dicha convocatoria.

2.3. Restricciones:

Para poder hacer la suma ponderada de las calificaciones anteriores, tanto en convocatoria ordinaria como en extraordinaria, es necesario obtener al menos un 5 en la prueba objetiva final. El alumno con nota inferior a 5 se considerará suspenso.

PROGRAMA DETALLADO TECNICAS CUANTITATIVAS PARA LA MODELIZACIÓN Y CONTROL DEL RIESGO EMPRESARIAL
--

Nº de sesión	Detalle del contenido docente: temas, casos prácticos, actividades académicas dirigidas que se verán en dicha sesión,...	Lecturas recomendadas o referencias bibliográficas relativas a los conceptos-temas desarrollados en la sesión
1	Introducción: Naturaleza del riesgo.	DV: 1 M: 1 @: 1
2	El Riesgo Empresarial.	M: 2 @: 2
3	Planificando un Análisis del Riesgo Empresarial. Elección de la Estructura del Modelo.	DV: 3-4 M: 3 @: 3
4	Modelo de Simulación I:	DV: 6 M: 4-7 @: 4
5	Modelo de Simulación II:	DV: 7 M: 5-7 @: 4
6	Modelo de Simulación III:	DV: 7 M: 6-7 @: 4
7	Análisis de Resultados.	DV: 5 M: 6 @: 4
8	Elaboración y Estimación de los Modelos de Riesgo Empresarial	DV: 9 M: 6
9	Distribuciones Estadísticas I: Compendio de Distribuciones.	DV: 9- Apéndice III M: Apéndice @: 5
10	Distribuciones Estadísticas II: Datos y Estimación de las Distribuciones.	DV: 10-11 M: 6 @: 5
11	Predicción con Incertidumbre.	DV: 12 M: 8-9 @: 6
12	Modelos de Correlación y Dependencia	DV: 13 M: 10-11 @: 6
13	Optimización en los Modelos de Riesgo	DV: 16

	Empresarial	M: 6 @: 6
14	Validación del Modelo	DV: 17 @: 6
15	Casos Prácticos	DV, M, @.

Bibliografía básica	<p>- DV: Risk Analysis. David Vose. Wiley. 2008</p> <p>- M: Modeling Risk. Johnathan Mun. Wiley. 2006</p> <p>- @: El Riesgo en la Empresa: Medida y Control mediante @risk. M. Cabeza y S. Torra. Palisade. 2007</p>
Bibliografía Complementaria	<p>- Mastering Risk Modelling: A practical guide to modelling uncertainty with Microsoft® Excel. Alastair Day. Prentice Hall. 2009</p> <p>- Financial Risk Manager Handbook. Philippe Jorion. Wiley. 2007</p>
Presentación de actividades académicas dirigidas	El alumno deberá entregar individualmente ejercicios y casos prácticos de cada sesión, que serán entregados en la clase siguiente. Se utilizará Ms-Excel y @risk.
Actividades Complementarias	Lecturas recomendadas para la realización de los casos.
Localización del profesor	<p>Prof. Dr. Ricardo A. Queralt Colegio Universitario de Estudios Financieros - CUNEF C/ Serrano Anguita, 8 – Madrid – C.P. 2800 Despacho 23. Email: ricardo.queralt@cunef.edu Tfno.: (+34) 91 448 08 92</p>

COMPETENCIAS:

BÁSICAS Y GENERALES	<p>CB6- Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación.</p> <p>CB7- Que los estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio.</p> <p>CB8- Que los estudiantes sean capaces de integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta o limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios.</p> <p>CB9- Que los estudiantes sepan comunicar sus conclusiones y los conocimientos y razones últimas que las sustentan a públicos especializados de un modo claro y sin ambigüedades.</p> <p>CG1- Capacidad para resolver problemas en entornos nuevos o poco conocidos</p>
----------------------------	--

	<p>CG2- Capacidad de análisis, síntesis y de formulación de juicios a partir de la información disponible.</p> <p>GG3- Capacidad de organización, planificación y toma de decisiones.</p> <p>CG4- Capacidad de comunicación y trabajo en equipo.</p>
TRANSVERSALES	<p>CT1- Capacidad de búsqueda de información e investigación y de aprendizaje continuo</p> <p>CT2- Capacidad para trabajar en entornos de presión.</p> <p>CT3- Capacidad para aplicar los conocimientos a la práctica.</p> <p>CT4- Usar tecnologías de la información y las telecomunicaciones.</p> <p>CT5- Capacidad para ejercer el liderazgo y mantener un espíritu emprendedor.</p>
ESPECÍFICAS	<p>CE10 Comprender y entender el funcionamiento de la gestión de los riesgos empresariales desde una perspectiva corporal integral. (Competencia específica de la especialidad de Riesgos Corporativos).</p>