

Programación semanal

En la programación semanal te presentamos un **reparto del trabajo de la asignatura** a lo largo de las semanas del cuatrimestre.

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 1	Tema 1. Valor en riesgo (<i>value at risk</i>, VaR) 1.1. Introducción y objetivos 1.2. Historia del VaR 1.3. Tipos de VaR 1.4. Medidas del riesgo	Huella UNIR (2,6 puntos)	Sesión de Presentación de la asignatura Clase del Tema 1
Semana 2	Tema 1. Valor en riesgo (<i>value at risk</i>, VaR) (continuación) 1.5. Parámetros del riesgo 1.6. Gestión del riesgo 1.7. Fórmulas y aplicaciones 1.8. Referencias bibliográficas	Test Tema 1 (0,1 punto)	Clase del Tema 1
Semana 3	Tema 2. Déficit esperado (<i>expected shortfall</i>, ES) 2.1. Introducción y objetivos 2.2. Historia y definición del ES 2.3. Comparación con otros métodos 2.4. Medidas de distribución 2.5. Fórmulas y aplicaciones 2.6. Referencias bibliográficas	Test Tema 2 (0,1 punto)	Clase del Tema 2
Semana 4	Tema 3. Pruebas de estrés y análisis de escenarios 3.1. Introducción y objetivos 3.2. Tipos de pruebas de estrés 3.3. Análisis de escenarios 3.4. Fórmulas y aplicaciones 3.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 3 (0,1 punto)	Clase del Tema 3
Semana 5	Tema 4. Valoración de opciones 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Historia y modelos 4.3. Método Black-Scholes 4.4. Fórmulas y aplicaciones 4.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 4 (0,1 punto)	Clase del Tema 4
Semana 6	Tema 5. Valoración de renta fija 5.1. Introducción y objetivos 5.2. Historia y definición 5.3. Medidas de riesgo en renta fija 5.4. Rentabilidad en renta fija 5.5. Fórmulas y aplicaciones 5.6. Referencias bibliográficas	Entrega Actividad 1 (3 puntos) Test Tema 5 (0,1 punto)	Clase del Tema 5

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 7	Tema 6. Coberturas 6.1. Introducción y objetivos 6.2. Historia y definición 6.3. Tipos de cobertura 6.4. Mediciones de riesgo en cobertura financiera 6.5. Fórmulas y aplicaciones 6.6. Referencias bibliográficas	Test Tema 6 (0,1 punto)	Clase del Tema 6
Semana 8	Tema 7. Modelos y gestión de riesgo país y soberano 7.1. Introducción y objetivos 7.2. Tipos de modelos de gestión de riesgo país y soberano 7.3. Mediciones de gestión de riesgo 7.4. Fórmulas y aplicaciones 7.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 7 (0,1 punto)	Clase de Resolución de la Actividad 1 Clase del Tema 7
Semana 9	Tema 8. Calificaciones crediticias externas e internas 8.1. Introducción y objetivos 8.2. Historia de la calificación crediticia 8.3. Parámetros de las calificaciones crediticias 8.4. Funciones de las calificaciones crediticias 8.5. Aplicaciones y funcionamiento 8.6. Referencias bibliográficas	Test Tema 8 (0,1 punto) Entrega Actividad 2 (3 puntos)	Clase del Tema 8
Semana 10	Tema 9. Pérdidas esperadas e inesperadas 9.1. Introducción y objetivos 9.2. Tipos de pérdidas 9.3. Tipos de pérdidas esperadas		Sesión de Recomendación de Examen Clase del Tema 9
Semana 11	Tema 9. Pérdidas esperadas e inesperadas (continuación) 9.4. Tipos de pérdidas inesperadas 9.5. Modelos de medición de pérdidas 9.6. Métodos de prevención y/o reducción de pérdidas 9.7. Referencias bibliográficas	Actividad grupal Lectura individual Test Tema 9 (0,1 punto)	Clase del Tema 9 Clase de Resolución de la Actividad 2
Semana 12		Actividad grupal Aula de discusión	Presentación de la Actividad Grupal

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 13	Tema 10. Riesgo operacional 10.1. Introducción y objetivos 10.2. Evaluación de riesgo 10.3. Modelos de medición 10.4. Métodos de prevención y/o reducción de pérdidas 10.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 10 (0,1 punto)	Clase del Tema 10
Semana 14		Entrega de Actividad Grupal (5,4 puntos)	Clase de Resolución de Actividad Grupal
Semana 15	Clase de Repaso		
Semana 16	Semana de exámenes		

NOTA

Esta **Programación semanal** puede ser modificada si el profesor lo considera oportuno para el enriquecimiento de la asignatura.