

## 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	<b>Tema 1. Objetivos de la gestión del riesgo de mercado</b> 1.1. Introducción y objetivos	<b>Huella UNIR</b> (2,8 puntos)	Sesión de presentación de la asignatura y clase del tema 1
Semana 2	<b>Tema 1. Objetivos de la gestión del riesgo de mercado</b> 1.2. Actividades que conllevan riesgo de mercado 1.3. Factores de riesgo de mercado	<b>Test tema 1</b> (0,1 punto)	Clase del tema 1
Semana 3	<b>Tema 2. Medidas básicas de riesgos de mercado</b> 2.1. Introducción y objetivos 2.2. La importancia de la valoración 2.3. Formas de medición de riesgos potenciales de mercado	<b>Test tema 2</b> (0,1 punto)	Clase del tema 2
Semana 4	<b>Tema 3. Medidas generales de riesgos de mercado: Value At Risk</b> 3.1. Introducción y objetivos 3.2. El concepto de <i>Value at Risk</i> 3.3. El concepto de <i>Earnings at Risk</i> 3.4. El concepto de <i>Expected Shortfall</i> 3.5. Metodologías del cálculo de VaR	<b>Test tema 3</b> (0,1 punto)	Clase del tema 3
Semana 5	<b>Tema 4. Metodología de simulación histórica para el cálculo de VaR</b> 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Premisas 4.3. Descripción	<b>Entrega actividad 1</b> (3 puntos)	Clase del tema 4
Semana 6	<b>Tema 4. Metodología de simulación histórica para el cálculo de VaR (continuación)</b> 4.4. Implementación	<b>Test tema 4</b> (0,1 punto)	Clase del tema 4

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 7	<b>Tema 5. Metodología de simulación de Montecarlo para el cálculo de VaR</b> 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Premisas 4.3. Descripción 4.4. Implementación	<b>Entrega actividad 2</b> (3 puntos)  <b>Test tema 5</b> (0,1 punto)	Clase de resolución de la actividad 1 y clase del tema 5
Semana 8	<b>Tema 6. Metodología paramétrica para el cálculo de VaR</b> 6.1. Introducción y objetivos 6.2. Premisas 6.3. Descripción 6.4. Implementación	<b>Test tema 6</b> (0,1 punto)	Clase del tema 6
Semana 9	<b>Tema 7. Backtesting</b> 7.1. Introducción y objetivos 7.2. Indicadores	<b>Actividad grupal</b> Lectura individual	Clase del tema 7 Clase de resolución de la actividad 2
Semana 10		<b>Actividad grupal</b> Aula de discusión	Presentación de la actividad grupal
Semana 11	<b>Tema 7. Backtesting</b> 7.3. Principios generales 7.4. Descripción técnica	<b>Test tema 7</b> (0,1 punto)	Sesión de Recomendación de Examen  Clase del tema 7
Semana 12		<b>Entrega actividad grupal</b> (5,4 puntos)	Clase de resolución de la actividad grupal
Semana 13	<b>Tema 8. Herramientas complementarias en la medición de riesgos</b> 8.1. Introducción y objetivos 8.2. Medidas de estrés 8.3. Modelos de dependencia: correlaciones y cópulas		Clase del tema 8

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 14	<b>Tema 8: Herramientas complementarias en la medición de riesgos</b> 8.4. Modelos de estructura de tipos de interés 8.5. Volatilidad: sonrisas y estructuras temporales	<b>Test</b> tema 8 (0,1 punto)	Clase del tema 8
Semana 15	<b>Clase de repaso</b>		
Semana 16	<b>Semana de exámenes</b>		

**NOTA**

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