



UNIVERSIDAD
POLITÉCNICA
DE MADRID

PROCESO DE
COORDINACIÓN DE LAS
ENSEÑANZAS PR/CL/001



E.T.S. de Ingenieros
Informaticos

ANX-PR/CL/001-01

GUÍA DE APRENDIZAJE

ASIGNATURA

105000430 - Gestión de Riesgos

PLAN DE ESTUDIOS

10ID - Doble Grado en Ingeniería Informática y en Ade

CURSO ACADÉMICO Y SEMESTRE

2020/21 - Primer semestre

Índice

Guía de Aprendizaje

1. Datos descriptivos.....	1
2. Profesorado.....	1
3. Competencias y resultados de aprendizaje.....	2
4. Descripción de la asignatura y temario.....	3
5. Cronograma.....	5
6. Actividades y criterios de evaluación.....	8
7. Recursos didácticos.....	10
8. Otra información.....	11

1. Datos descriptivos

1.1. Datos de la asignatura

Nombre de la asignatura	105000430 - Gestión de Riesgos
No de créditos	3 ECTS
Carácter	Obligatoria
Curso	Quinto curso
Semestre	Noveno semestre
Período de impartición	Septiembre-Enero
Idioma de impartición	Castellano
Titulación	10ID - Doble Grado en Ingeniería Informática y en Ade
Centro responsable de la titulación	10 - Escuela Técnica Superior de Ingenieros Informaticos
Curso académico	2020-21

2. Profesorado

2.1. Profesorado implicado en la docencia

Nombre	Despacho	Correo electrónico	Horario de tutorías *
Barbara Soriano Martinez (Coordinador/a)		barbara.soriano@upm.es	M - 16:00 - 18:00 J - 16:00 - 18:00 El horario de tutoría está sujeto a cambios. Se recomienda confirmar horarios previamente con el profesor

* Las horas de tutoría son orientativas y pueden sufrir modificaciones. Se deberá confirmar los horarios de tutorías con el profesorado.

3. Competencias y resultados de aprendizaje

3.1. Competencias

30AD-CB04 - Que los estudiantes puedan transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.

30AD-CE13 - Aplicar las herramientas de planificación financiera.

30AD-CE14 - Comprender las principales operaciones integradas en el ámbito de las finanzas corporativas.

30AD-CE15 - Entender el funcionamiento de los mercados financieros nacionales e internacionales.

30AD-CE02 - Comprender el impacto de las operaciones económicas que desarrollan las empresas en su patrimonio empresarial.

30AD-CE10 - Comprender los procesos para la gestión financiera de las empresas.

30AD-CE12 - Comprender la operativa de las operaciones financieras.

3.2. Resultados del aprendizaje

RA290 - Conocimiento de las instituciones financieras y tributarias relacionadas con la administración y dirección de empresas

RA137 - Comprender y resolver los problemas de asignación de recursos financieros que suceden en los mercados financieros.

RA179 - Conocer el intercambio de recursos económicos a lo largo del tiempo entre los individuos, empresas e instituciones financieras, lo que implica el análisis de las decisiones de inversiones y financiación en la empresa, la teoría de carteras, la valoración de activos y el funcionamiento de los mercados financieros.

4. Descripción de la asignatura y temario

4.1. Descripción de la asignatura

La asignatura abarca en el conocimiento y comprensión de los instrumentos financieros como instrumentos de cobertura de los riesgos asumidos por la empresa: los riesgos de precios, tipos de interés y tipo de cambio. Para ello se parte de una introducción de los mercados financieros y productos cotizados y de la definición del riesgo financiero y su medición. A continuación se estudian los instrumentos derivados, las opciones y los futuros y las distintas estrategias de cobertura de riesgos.

4.2. Temario de la asignatura

1. T.1 Los mercados, productos y riesgos financieros
 - 1.1. Los mercados e instrumentos financieros
 - 1.2. Los tipos de riesgos financieros
2. T.2. Los mercados de renta fija
 - 2.1. Instituciones en el mercado de renta fija
 - 2.2. Productos de renta fija
 - 2.3. Medida de riesgo de renta fija. Duración y sensibilidad
3. T.3. Los mercados de renta variable
 - 3.1. Instituciones en el mercado de renta variable
 - 3.2. Productos de renta variable
 - 3.3. Medición de riesgo en renta variable. Volatilidad
4. T.4. Los productos derivados
 - 4.1. Instituciones en el mercado de derivados
 - 4.2. Opciones y Futuros
 - 4.3. Estrategias con opciones financieras
5. T.5. El mercado Forex
 - 5.1. Instituciones en el mercado Forex
 - 5.2. Operativa en el mercado de divisas
6. Cálculo de la exposición al riesgo en carteras

6.1. Value at Risk- VaR

5. Cronograma

5.1. Cronograma de la asignatura *

Sem	Actividad presencial en aula	Actividad presencial en laboratorio	Tele-enseñanza	Actividades de evaluación
1			Tema 1. Introducción Duración: 02:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral	
2			Tema 2. Mercado de renta fija Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral Tema 2. El mercado de renta fija Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	
3			Tema 2. Mercado de renta fija Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral Tema 2. El mercado de renta fija Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	
4			Tema 2. El mercado de renta fija Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	Prueba evaluable individual 1 TI: Técnica del tipo Trabajo Individual Evaluación continua No presencial Duración: 01:00
5			Tema 3. Mercado de renta variable Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral Tema 3. Mercado de renta variable Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	
6			Tema 3. Mercado de renta variable Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral Tema 3. Mercado de renta variable Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	
7			Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas	

8			<p>Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral</p> <p>Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	
9			<p>Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral</p> <p>Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	
10			<p>Tema 4. Mercado derivados Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	<p>Prueba evaluable individual 2 TI: Técnica del tipo Trabajo Individual Evaluación continua No presencial Duración: 01:00</p>
11			<p>Tema 5. Mercado forex Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral</p> <p>Tema 5. Mercado forex Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	
12			<p>Tema 5. Mercado forex Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral</p> <p>Tema 5. Mercado forex Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	
13			<p>Tema 6. Valoración exposición al riesgo Duración: 01:00 LM: Actividad del tipo Lección Magistral</p> <p>Tema 6. Valoración exposición al riesgo Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	
14			<p>Tema 6. Valoración exposición al riesgo Duración: 01:00 PR: Actividad del tipo Clase de Problemas</p>	<p>Prueba evaluable individual 3 TI: Técnica del tipo Trabajo Individual Evaluación continua No presencial Duración: 01:00</p>
15				<p>Presentación trabajo en grupo TG: Técnica del tipo Trabajo en Grupo Evaluación continua No presencial Duración: 02:00</p>
16				
17				<p>Examen final. Evaluación continua EX: Técnica del tipo Examen Escrito Evaluación continua Presencial Duración: 02:00</p> <p>Examen final. Evaluación NO continua EX: Técnica del tipo Examen Escrito Evaluación sólo prueba final Presencial</p>

				Duración: 02:00 Presentación trabajo. Evaluación NO continua PI: Técnica del tipo Presentación Individual Evaluación sólo prueba final No presencial Duración: 00:30
--	--	--	--	--

Para el cálculo de los valores totales, se estima que por cada crédito ECTS el alumno dedicará dependiendo del plan de estudios, entre 26 y 27 horas de trabajo presencial y no presencial.

* El cronograma sigue una planificación teórica de la asignatura y puede sufrir modificaciones durante el curso derivadas de la situación creada por la COVID-19.

6. Actividades y criterios de evaluación

6.1. Actividades de evaluación de la asignatura

6.1.1. Evaluación continua

Sem.	Descripción	Modalidad	Tipo	Duración	Peso en la nota	Nota mínima	Competencias evaluadas
4	Prueba evaluable individual 1	TI: Técnica del tipo Trabajo Individual	No Presencial	01:00	10%	/ 10	30AD-CB04 30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14
10	Prueba evaluable individual 2	TI: Técnica del tipo Trabajo Individual	No Presencial	01:00	10%	/ 10	30AD-CB04 30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14
14	Prueba evaluable individual 3	TI: Técnica del tipo Trabajo Individual	No Presencial	01:00	10%	/ 10	30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CB04 30AD-CE13 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14
15	Presentación trabajo en grupo	TG: Técnica del tipo Trabajo en Grupo	No Presencial	02:00	20%	/ 10	30AD-CB04 30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14
17	Examen final. Evaluación continua	EX: Técnica del tipo Examen Escrito	Presencial	02:00	50%	4 / 10	30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14

6.1.2. Evaluación sólo prueba final

Sem	Descripción	Modalidad	Tipo	Duración	Peso en la nota	Nota mínima	Competencias evaluadas
17	Examen final. Evaluación NO continua	EX: Técnica del tipo Examen Escrito	Presencial	02:00	70%	5 / 10	30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14
17	Presentación trabajo. Evaluación NO continua	PI: Técnica del tipo Presentación Individual	No Presencial	00:30	30%	/ 10	30AD-CB04

6.1.3. Evaluación convocatoria extraordinaria

Descripción	Modalidad	Tipo	Duración	Peso en la nota	Nota mínima	Competencias evaluadas
Trabajos realizados durante el curso	TI: Técnica del tipo Trabajo Individual	Presencial	00:00	30%	/ 10	30AD-CB04
Evaluación extraordinaria	EX: Técnica del tipo Examen Escrito	Presencial	02:00	70%	5 / 10	30AD-CB04 30AD-CE13 30AD-CE02 30AD-CE12 30AD-CE15 30AD-CE10 30AD-CE14

6.2. Criterios de evaluación

Durante el curso se realizan diversas actividades formativas, tanto individuales como colectivas, con el objetivo de que el alumnado pueda adquirir las competencias asociadas a la asignatura.

De manera general se aplica un sistema de evaluación continua, la cual requiere la asistencia a las clases presenciales y la participación en las prácticas desarrolladas en el aula (30% de la nota), la elaboración y exposición oral de un trabajo en grupo (20% de la nota) y la realización de un examen (50% de la nota) .

Los estudiantes que lo deseen podrán ser evaluados mediante una única prueba final que recoge el contenido completo de la asignatura. Esto supone la renuncia a la evaluación continua y es necesario que lo comuniquen por escrito al profesor responsable de la asignatura durante las tres primeras semanas del curso. En este caso, la evaluación consistirá en la realización de un examen que constará de preguntas teórico prácticas, cuya calificación tendrá un valor del 70% sobre la nota final, y la elaboración y exposición oral de un trabajo, con una ponderación

del 30% sobre la nota global.

En la convocatoria extraordinaria se realizará un examen que abarca el contenido completo de la asignatura. Tanto a los alumnos que en su momento optaron por la evaluación continua, como a aquellos que en su momento no optaron por la evaluación continua, se les guardará para la convocatoria extraordinaria las calificaciones obtenidas en las prácticas.

7. Recursos didácticos

7.1. Recursos didácticos de la asignatura

Nombre	Tipo	Observaciones
Manual del asesor financiero	Bibliografía	Autores: Myriam García Olalla y Francisco Javier Martínez. Edición Paraninfo
Gestión del riesgo y mercados financieros	Bibliografía	Autor: Olga del Orden Olasagasti. Edición. Delta

Materiales en Moodle	Otros	Materiales disponibles en Moodle
Paginas web de Mercados financieros_ Bolsas, MEEF, AIAF	Recursos web	Información actualizada de cotización de productos financieros

8. Otra información

8.1. Otra información sobre la asignatura

La comunicación con los alumnos se realizará a través de la plataforma moodle o bien directamente a través del correo electrónico barbara.soriano@upm.es en horario de 9h a 17h. Las consultas serán respondidas en un plazo entre 24-48 horas.

La plataforma para impartir las clases por videoconferencia sí como para compartir los recursos didácticos será collaborate accesible a través de Moodle.

Dado el perfil de la asignatura, cuyo objetivo principal es conocer el funcionamiento de los mercados financieros y los instrumentos y estrategias de las que disponen las empresas para cubrir los riesgos financieros, la asignatura está relacionada con la consecución de los Objetivos de Desarrollo Sostenible de Naciones Unidas (ODS), concretamente los siguientes:

ODS 8. Trabajo decente y crecimiento económico

ODS 9. Industria, innovación e infraestructuras.

ODS 12. Consumo y producción responsable.