

## Guía docente

### Identificación de la asignatura

<b>Asignatura / Grupo</b>	21212 - Gestión de Riesgos Empresariales / 78
<b>Titulación</b>	Grado en Administración de Empresas - Tercer curso
<b>Créditos</b>	6
<b>Período de impartición</b>	Primer semestre
<b>Idioma de impartición</b>	Castellano

### Profesores

#### Horario de atención a los alumnos

Profesor/a	Hora de inicio	Hora de fin	Día	Fecha inicial	Fecha final	Despacho / Edificio
María Magdalena Massot Perelló <i>Responsable</i> <a href="mailto:m.massot@uib.es">m.massot@uib.es</a>	11:00	12:00	Viernes	01/09/2019	31/07/2020	DB-115 / Ed. Jovellanos

### Contextualización

Esta asignatura es obligatoria para: GADE (primer semestre de tercero ); GAID (primer semestre de cuarto); GATU (primer semestre de tercero)

El objetivo de esta asignatura consiste en proporcionar al alumno un amplio conjunto de conocimientos sobre los distintos instrumentos existentes para la cobertura de los riesgos empresariales de carácter financiero. Atendiendo a este objetivo, las cuestiones específicamente contempladas incluyen el estudio de las características de los activos derivados, la descripción y aplicación de las principales metodologías para su valoración y el diseño de estrategias de cobertura de riesgos de carácter financiero.

Por tanto, con esta asignatura se pretende capacitar al alumno para asumir responsabilidades directivas y de gestión en entornos competitivos, globales y dinámicos. Asimismo, proporciona a los alumnos los conocimientos necesarios par el manejo de diversas herramientas e instrumentos de gestión necesarios para dirigir una empresa.

### Requisitos

#### Recomendables

20602 Introducción a los Mercados y Operaciones Financieras

20606 Análisis de Datos Económicos

21202 Economía Financiera

## Guía docente

20207 Inversión y Financiación Empresarial

### Competencias

#### Específicas

- \* CE1 (CB1) Poseer y comprender conocimientos del área de estudio de la administración y la dirección de empresas a partir de la base de la educación secundaria general, a un nivel que, si bien se apoya en libros de texto avanzados, incluye también algunos aspectos que implican conocimientos procedentes de la vanguardia de la administración y la dirección de empresas.
- \* CE2 (CB2) Saber aplicar los conocimientos de administración y dirección de empresas a su trabajo o vocación de una forma profesional y poseer las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro del área de administración y dirección de empresas.

#### Genéricas

- \* CG1 Capacidad para trabajar en equipo.
- \* CG6 (CB4) Poder transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.
- \* CG7 (CB5) Haber desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para poder emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía.

#### Básicas

- \* Se pueden consultar las competencias básicas que el estudiante tiene que haber adquirido al finalizar el grado en la siguiente dirección: [http://estudis.uib.cat/es/grau/comp\\_basiques/](http://estudis.uib.cat/es/grau/comp_basiques/)

### Contenidos

#### Contenidos temáticos

- Tema 1. El riesgo y su gestión
- Tema 2. Forwards y futuros
- Tema 3. Opciones y swaps
- Tema 4. Valoración de opciones
- Tema 5. Futuros y opciones sobre mercancías
- Tema 6. Gestión del riesgo de tipos de interés
- Tema 7. Gestión del riesgo de tipo de cambio

### Metodología docente

Actividades de trabajo presencial (1,8 créditos, 45 horas)



## Guía docente

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Clases teóricas	Clases magistrales	Grupo grande (G)	Explicar el contenido teórico de la asignatura.	20
Clases prácticas	Resolución de ejercicios	Grupo mediano (M)	Aplicar los conocimientos adquiridos en las clases teóricas.	20
Evaluación	Prueba 1. Tema 2, Tema 3 y Tema 4	Grupo mediano (M)	Evaluar los conocimientos de los Temas 2, 3 y 4 con la realización de ejercicios teóricos y/o prácticos.	1.5
Evaluación	Prueba 2. Tema 5, Tema 6 y Tema 7	Grupo mediano (M)	Evaluar los conocimientos de los Temas 5, 6 y 7 con la realización de ejercicios teóricos y/o prácticos.	1.5
Evaluación	Examen final	Grupo grande (G)	Evaluar globalmente los conocimientos adquiridos en la asignatura	2

Al inicio del semestre estará a disposición de los estudiantes el cronograma de la asignatura a través de la plataforma UIBdigital. Este cronograma incluirá al menos las fechas en las que se realizarán las pruebas de evaluación continua y las fechas de entrega de los trabajos. Asimismo, el profesor o la profesora informará a los estudiantes si el plan de trabajo de la asignatura se realizará a través del cronograma o mediante otra vía, incluida la plataforma Aula Digital.

### Actividades de trabajo no presencial (4,2 créditos, 105 horas)

Modalidad	Nombre	Descripción	Horas
Estudio y trabajo autónomo individual o en grupo	Estudio de la asignatura	Consolidar y reforzar los conocimientos para poder enfrentarse con éxito a cada una de las pruebas evaluables.	105

### Riesgos específicos y medidas de protección

Las actividades de aprendizaje de esta asignatura no conllevan riesgos específicos para la seguridad y salud de los alumnos y, por tanto, no es necesario adoptar medidas de protección especiales.

## Evaluación del aprendizaje del estudiante

### Fraude en elementos de evaluación

De acuerdo con el artículo 33 del Reglamento Académico, "con independencia del procedimiento disciplinario que se pueda seguir contra el estudiante infractor, la realización demostrablemente fraudulenta de alguno de los elementos de evaluación incluidos en guías docentes de las asignaturas comportará, a criterio del profesor, una minusvaloración en su calificación que puede suponer la calificación de «suspense 0» en la evaluación anual de la asignatura".

## Guía docente

### Prueba 1. Tema 2 , Tema 3 y Tema 4

---

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas de respuesta larga, de desarrollo <b>(no recuperable)</b>
Descripción	Evaluar los conocimientos de los Temas 2, 3 y 4 con la realización de ejercicios teóricos y/o prácticos.
Criterios de evaluación	Se propondrán ejercicios teóricos y/o prácticos.

Porcentaje de la calificación final: 25%

### Prueba 2. Tema 5, Tema 6 y Tema 7

---

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas de respuesta larga, de desarrollo <b>(no recuperable)</b>
Descripción	Evaluar los conocimientos de los Temas 5, 6 y 7 con la realización de ejercicios teóricos y/o prácticos.
Criterios de evaluación	Se propondrán ejercicios teóricos y/o prácticos.

Porcentaje de la calificación final: 25%

### Examen final

---

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas de respuesta larga, de desarrollo <b>(recuperable)</b>
Descripción	Evaluar globalmente los conocimientos adquiridos en la asignatura
Criterios de evaluación	Se valorará las respuestas a diversos ejercicios numéricos y diferentes cuestiones teóricas.

Nota mínima exigida para que sea evaluable: 4.

Porcentaje de la calificación final: 50% con calificación mínima 4

## Recursos, bibliografía y documentación complementaria

---

### Bibliografía básica

---

HULL, J.C. *Introducción a los mercados de futuros y opciones*. Madrid: Prentice Hall, 2003.

### Bibliografía complementaria

---

GRIMBLATT, M. Y S. TITMAN. *Mercados financieros y estrategia empresarial*. Madrid: McGraw Hill, 2010.

### Otros recursos

---

<http://www.cmegroup.com/trading/fx>

<http://www.meff.es>

<http://www.euronext.com/landing/landingInfo-2123-EN.html>

[http://www.bolsamadrid.es/esp/contenido.asp?menu=3&enlace=/esp/mercados/warrants/warrants\\_IN\\_0.htm](http://www.bolsamadrid.es/esp/contenido.asp?menu=3&enlace=/esp/mercados/warrants/warrants_IN_0.htm)





## Guía docente

<http://www.cmegroup.com/company/cbot.html>

<http://www.euronext.com/landing/landingInfo-3127-EN.html>

<http://www.cmegroup.com/product-codes-listing/nymex-market.html>

<http://www.mfao.es>

