

1. DATOS BÁSICOS

Asignatura	Análisis y gestión de riesgos
Titulación	Grado en Administración y Dirección de Empresas
Escuela/ Facultad	Ciencias Sociales y de la Comunicación
Curso	Cuarto
ECTS	6 ECTS
Carácter	Optativo
Idioma/s	Español
Modalidad	Presencial
Semestre	Primer semestre
Curso académico	2024/2025
Docente coordinador	Juan Francisco Del Brío Carretero

2. PRESENTACIÓN

La asignatura “Análisis y gestión de riesgos” es una asignatura optativa que se imparte en el cuarto curso del grado en Administración de Empresas. Es una asignatura clave para aquellos alumnos que quieran especializarse en el área de finanzas y de gestión de empresas, ya que en la misma se aprende a detectar los riesgos financieros que se pueden presentar a las empresas y cómo realizar coberturas de riesgos utilizando instrumentos financieros derivados.

3. RESULTADOS DE APRENDIZAJE

Conocimientos

CON1. Definir los conceptos fundamentales sobre la empresa, el empresario, y su entorno, así como las principales áreas funcionales y problemas de la empresa como organización en una economía de mercado.

- Comprender los principales riesgos empresariales y aplicación de estrategias de cobertura.

Habilidades

HAB2. Resolver problemas y casos prácticos utilizando técnicas y herramientas matemáticas y de análisis de datos para la resolución de problemas económicos y la utilización de los métodos básicos de cálculo, álgebra y programación que permitan una mejor comprensión del funcionamiento operativo de la empresa y su entorno.

HAB6. Analizar los mercados financieros, su estructura, agentes y productos, así como aplicar estrategias de cobertura de riesgos (“hedging”), mediante el uso de productos derivados (futuros, opciones, SWAPs, FRAs, seguros de cambio).

- Analizar problemas, casos y actividades que permitan demostrar que el alumno es capaz de aplicar los conceptos descritos en el apartado anterior.

Competencias

COMP07. Seleccionar la mejor alternativa de planificación financiera y fiscal, así como las herramientas disponibles de gestión, para ser aplicadas en los mercados y compañías en los que se desarrolla la actividad.

COMP09. Integrar los distintos presupuestos de la empresa y relacionarlo con los costes estándares técnicos y económicos y análisis de las desviaciones, interpretando la información suministrada por los estados financieros de una empresa.

4. CONTENIDOS

La materia está organizada en las siguientes unidades:

Unidad 1. Identificación y análisis de los distintos tipos de riesgo empresarial.

Unidad 2. Control y gestión de riesgos financieros.

Unidad 3. Productos derivados:

3.1. Contratos de futuros

3.2. Opciones financieras

3.3. SWAPS y otros productos derivados.

Unidad 4. Estrategias de cobertura (hedging).

5. METODOLOGÍAS DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE

A continuación, se indican los tipos de metodologías de enseñanza-aprendizaje que se aplicarán:

Modalidad presencial:

- Método del caso.
- Aprendizaje cooperativo.
- Aprendizaje basado en problemas(ABP).
- Clases magistrales.

Modalidad online:

- Método del caso.
- Aprendizaje cooperativo.
- Aprendizaje basado en problemas(ABP).
- Clases magistrales mediante seminario online.

6. ACTIVIDADES FORMATIVAS

A continuación, se identifican los tipos de actividades formativas que se realizarán y la dedicación en horas del estudiante a cada una de ellas:

Modalidad presencial:

Actividad formativa	Número de horas	% de presencialidad
Lecciones magistrales	40	100%
Trabajo autónomo	30	0%
Exposiciones orales	10	100%

Análisis de casos y resolución de problemas	15	60%
Actividades participativas grupales	25	25%
Pruebas de conocimiento	5	100%
Tutoría	15	75%
Elaboración de informes y escritos	10	25%
TOTAL	150	

Modalidad online:

Actividad formativa	Número de horas	% de presencialidad
Seminario virtual	5	0%
Lectura de temas y consulta de recursos complementarios	22,5	0%
Actividades de aplicación individuales: problemas, casos, proyectos	35	0%
Actividades de aplicación colaborativas	12,5	0%
Tutorías	17,5	0%
Cuestionarios de autoevaluación y pruebas de conocimiento	7,5	50%
Estudio autónomo	50	0%
TOTAL	150	

7. EVALUACIÓN

A continuación, se relacionan los sistemas de evaluación, así como su peso sobre la calificación total de la asignatura:

Sistema de evaluación	Peso
Prueba de conocimiento	50%
Análisis de casos, resolución de problemas	15%
Informes escritos	20%
Exposiciones orales	10%
Participación en debates y foros	5%

En el Campus Virtual, cuando accedas a la asignatura, podrás consultar en detalle las actividades de evaluación que debes realizar, así como las fechas de entrega y los procedimientos de evaluación de cada una de ellas.

7.1. Convocatoria ordinaria

Para superar la asignatura en convocatoria ordinaria deberás obtener una calificación mayor o igual que 5,0 sobre 10,0 en la calificación final (media ponderada) de la asignatura.

En todo caso, será necesario que obtengas una calificación mayor o igual que 4,0 en la prueba final, para que la misma pueda hacer media con el resto de actividades.

7.2. Convocatoria extraordinaria

Para superar la asignatura en convocatoria extraordinaria deberás obtener una calificación mayor o igual que 5,0 sobre 10,0 en la calificación final (media ponderada) de la asignatura.

En todo caso, será necesario que obtengas una calificación mayor o igual que 4,0 en la prueba final, para que la misma pueda hacer media con el resto de actividades.

Se deben entregar las actividades no superadas en convocatoria ordinaria, tras haber recibido las correcciones correspondientes a las mismas por parte del docente, o bien aquellas que no fueron entregadas.

8. CRONOGRAMA

En este apartado se indica el cronograma con fechas de entrega de actividades evaluables de la asignatura:

Actividades evaluables	Fecha
Actividad 1. Identificación y análisis de los distintos tipos de riesgo empresarial.	Semana 3-4
Actividad 2. Contratos de futuros	Semana 5-8
Actividad 3. Opciones financieras	Semana 9-12
Actividad 4. SWAPS y otros productos	Semana 13-14
Actividad 6. Prueba intermedia	Semana 13
Actividad 8. Informe de derivados y estrategias de cobertura	Semana 14- 18
Actividad 7. Prueba final	Semana 18

Este cronograma podrá sufrir modificaciones por razones logísticas de las actividades. Cualquier modificación será notificada al estudiante en tiempo y forma.

9. BIBLIOGRAFÍA

- Brealey, R., Myers, S. y Allen, F. (2015). Principios de Finanzas Corporativas. Mc Graw Hill. 11ª Edición.
- Elvira, Ó. y Larraga, P. (2008). Mercado de productos derivados. Bresca Editorial, S.L. Barcelona.

Bibliografía complementaria:

- Núñez, F. (2010). Gestión de riesgos en la empresa internacional: riesgos políticos, riesgos catastróficos o extraordinarios. Global Marketing, D.L. Madrid.
- Warren, Edwardes (2001). Instrumentos financieros fundamentales. Madrid, D.L.

10. UNIDAD DE ORIENTACIÓN EDUCATIVA Y DIVERSIDAD

Desde la Unidad de Orientación Educativa y Diversidad (ODI) ofrecemos acompañamiento a nuestros estudiantes a lo largo de su vida universitaria para ayudarles a alcanzar sus logros académicos. Otros de los pilares de nuestra actuación son la inclusión del estudiante con necesidades específicas de apoyo educativo, la accesibilidad universal en los distintos campus de la universidad y la equiparación de oportunidades.

Desde esta Unidad se ofrece a los estudiantes:

1. Acompañamiento y seguimiento mediante la realización de asesorías y planes personalizados a estudiantes que necesitan mejorar su rendimiento académico.
2. En materia de atención a la diversidad, se realizan ajustes curriculares no significativos, es decir, a nivel de metodología y evaluación, en aquellos alumnos con necesidades específicas de apoyo educativo persiguiendo con ello una equidad de oportunidades para todos los estudiantes.
3. Ofrecemos a los estudiantes diferentes recursos formativos extracurriculares para desarrollar diversas competencias que les enriquecerán en su desarrollo personal y profesional.
4. Orientación vocacional mediante la dotación de herramientas y asesorías a estudiantes con dudas vocacionales o que creen que se han equivocado en la elección de la titulación

Los estudiantes que necesiten apoyo educativo pueden escribirnos a:

orientacioneducativa@universidadeuropea.es

11. ENCUESTAS DE SATISFACCIÓN

¡Tu opinión importa!

La Universidad Europea te anima a participar en las encuestas de satisfacción para detectar puntos fuertes y áreas de mejora sobre el profesorado, la titulación y el proceso de enseñanza-aprendizaje.

Las encuestas estarán disponibles en el espacio de encuestas de tu campus virtual o a través de tu correo electrónico.

Tu valoración es necesaria para mejorar la calidad de la titulación.

Muchas gracias por tu participación.