

Grau d'Estadística Aplicada
Gestió del Risc



Curs 2010-2011

Professor

Anna López Ratera

annalop@mat.uab.cat

Horari de consultes: A convenir per correu electrònic a l'adreça anterior.

Contingut

RISC: "La Possibilitat de que es produeixi un esdeveniment que tingui un impacte en l'abast dels objectius. El risc es mesura en termes d'impacte i probabilitat".

1. Risc de mercat
 - 1.1. Risc de Tipus d'interès
 - 1.1.1. Concepte i estructura temporal del tipus de interès
 - 1.1.2. Títols de Renta fixa
 - 1.1.3. Concepte de risc de tipus d'interès
 - 1.1.4. Productes d'inversió, cobertura o finançament en tipus d'interès
 - 1.1.4.1. FRA (Forward Rate Agreement) i futurs sobre tipus de interès
 - 1.1.4.2. Swap i corba de tipus swap
 - 1.1.4.3. Cap, floor i collar
 - 1.1.4.4. Swaption
 - 1.1.4.5. Opcions exòtiques sobre tipus d'interès
 - 1.2. Risc de Tipus de canvi
 - 1.2.1. Preus Spot i Forward
 - 1.2.2. Paritat de tipus d'interès
 - 1.2.3. Productes d'inversió, cobertura o finançament en tipus de canvi
 - 1.2.3.1. Contracte Forward
 - 1.2.3.2. Opcions sobre tipus de canvi: call, put, ...
 - 1.3. Risc de mercat - volatilitat dels instruments financers (accions, deute, derivats,..)
2. Risc de crèdit
 - 2.1. Concepte de Risc de crèdit
 - 2.2. Diferencial de liquiditat
 - 2.3. Derivats de crèdit: CDS/CDO
3. Risc de liquiditat

Funcionament del curs

El curs consta de 14 sessions, que comencen tots els dimarts hàbils des del 15 de febrer fins el 31 de maig, ambdós inclosos.

Les sessions es basaran en la presentació dels apunts de l'assignatura que us podeu descarregar setmanalment de l'espai docent de l'assignatura que trobareu en el campus virtual. Cada sessió contindrà una presentació teòrica dels conceptes que s'introdueixin, exemples pràctics resolts i exercicis que es proposaran per resoldre individualment. Alguns d'aquests exercicis seran de lliurament obligatori per a formar part de l'avaluació (veure apartat Avaluació).

Avaluació

L'avaluació serà un 50% de la qualificació obtinguda dels exercicis que s'han de lliurar obligatòriament i un 50% de la qualificació de una prova escrita.

Les dates dels exercicis que s'han de lliurar obligatòriament es publicaran al campus virtual.

La data prevista de la prova escrita és divendres 10 de juny.

Recordeu que les assignatures de la Diplomatura comparteixen docència i avaluació amb assignatures del Grau d'Estadística Aplicada i que per tant tots els alumnes disposeu d'una única convocatòria.

Bibliografia

El dimarts de cada setmana us podeu descarregar en l'espai docent de l'assignatura el material corresponent a la sessió que pertoca aquella setmana. En cada sessió hi trobareu la bibliografia complementària als apunts.

Bibliografia complementària

- Paul Wilmott on Quantitative Finance, Vol 1-3
- Options, Futures, and Other Derivatives (Hull, J.)