

MASTER		Master en Data Science para Finanzas
ASIGNATURA	<i>Gestión del Riesgo Operativo</i>	
Nº de ECTS	1,5	
Nº de horas docentes	15	
Nº de horas actividades académicas dirigidas		
Profesor responsable de la asignatura	Sonia de Paz Cobo	
Curso académico	2020/ 2021	
Cuatrimestre	Segundo Cuatrimestre	

1.- DESCRIPCIÓN GENERAL DE LA ASIGNATURA Y OBJETIVOS DE DOCENCIA:

La presente asignatura introduce al alumno en el concepto de riesgo operativo, así como en su medida, cuantificación y modelización.

- I. Introducción al Riesgo Operacional
- II. Modelización estocástica
 - a. Modelos de severidad
 - b. Teoría del valor extremo
 - c. Modelos de frecuencia
 - d. Distribución de pérdidas agregadas
 - e. Value at Risk Operacional

2.- FORMA DE EVALUACIÓN PREVISTA:

Participación activa	10%
Actividades académicas dirigidas	40%
Prueba objetiva final	50%

PROGRAMA DETALLADO

Nº de sesión	Detalle del contenido docente: temas, casos prácticos, actividades académicas dirigidas que se verán en dicha sesión,...	Lecturas recomendadas o referencias bibliográficas relativas a los conceptos-temas desarrollados en la sesión
1-2	Introducción al riesgo operativo. Practica	Cruz: Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk.
3-4	Modelos de severidad y teoría del valor extremo. Práctica	Cruz: Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk.
5-6	Modelos de frecuencia. Práctica	Cruz: Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk.
7-8	Distribución de pérdida agregada. Práctica	Cruz: Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk.
9-10	Value at Risk. Estudio de casos	Cruz: Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk.

INFORMACION ADICIONAL	
Bibliografía básica	<ul style="list-style-type: none">- Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk. <i>Marcelo G. Cruz</i>. John Wiley and Sons (2003) ISBN:0 471 51560 4- Quantitative risk Management. Concepts, Techniques and Tools. McNeil, A., et al. Princeton series in finance (2015) ISBN :978-0-691-16627-8
Bibliografía Complementaria	Se señalará durante la clase
Actividades Complementarias	Se señalarán durante la clase
Localización del profesor	Mediante mensaje a la cuenta de correo electrónico