

Plan Docente

- **Curso:** Managing Risk in international finance
 - **Créditos:** 6 ECTS
 - **Programa:** Administración y Dirección de Empresas
 - **Módulo:** Managing Risk
 - **Materia:** Optativa
 - **Código:** 802263
 - **Abreviación:** MA12
 - **Coordinador de la materia:** Cristina Tomàs
 - **Año académico:** 2022-2023
 - **Convocatoria:** Febrero
 - **Semestre:** Segundo (cuarto curso, Semestre de primavera)
 - **Campus:** Barcelona
 - **Última Revisión:** 31/01/2023
 - **Aprobación:** 31/01/2023
 - **Publicación:** 02/02/2023
-

oo Contenidos

oo Contenidos.....	2
01 Profesorado.....	3
01.1 Coordinadora de la materia	3
02 Presentación.....	3
02.1 Descripción.....	3
02.2 Aplicaciones profesionales relevantes	3
03 Competencias	4
03.1 Competencias de la materia	4
04 Programa.....	5
05 Metodología docente	6
06 Actividades formativas	6
07 Evaluación	7
08 Recursos de aprendizaje	7
09 Código de conducta académica	8
10 Bibliografía	9
10.1 Basic bibliography	9
10.2 Recommended bibliography	9

01 Profesorado

01.1 Coordinadora de la materia

Dra. Cristina Tomàs

ctomas@eae.es

02 Presentación

02.1 Descripción

Las compañías globales enfrentan continuamente una variedad cada vez mayor de riesgos comerciales, políticos, económicos y de seguridad que pueden afectar directamente tanto la operación como las ganancias. Este curso identifica y analiza los entornos de riesgo multinivel que enfrentan las empresas globales de hoy e investiga estrategias para identificar, evaluar, gestionar y mitigar el riesgo internacional y geopolítico.

A partir de la empresa multinacional; riesgo operativo, cambiario, de tipos de interés variable y soberano; riesgo financiero y económico; los estudiantes investigan los diversos enfoques analíticos involucrados en el diseño de sistemas de identificación de riesgos, informes y protocolos de monitoreo, y cómo el riesgo se puede evaluar, priorizar y gestionar de manera efectiva.

02.2 Aplicaciones profesionales relevantes

- Análisis y Gestión de Créditos y Cobranzas
- Desarrollo de Negocios
- Gestión Financiera y Contraloría
- Gestión de Riesgos Corporativos
- Gestión de ventas y Marketing

03 Competencias

03.1 Competencias de la materia

Competencias específicas

- CE01 – Explicar y aplicar marcos de gestión de riesgos cuando se opera en entornos empresariales globales.
- CE02 - Identificar y explicar teorías de riesgo y gestión de riesgos en entornos de negocios internacionales.
- CE03 - Aplicar estrategias de diversificación y gestión de riesgo de tipos de cambio, de gestión de mercancías y de tipos de interés, empleando estrategias básicas y usando productos financieros derivados.

Competencias generales

- CG02 – Comunicarse de forma oral y escrita con otras personas sobre los resultados del aprendizaje, de la elaboración del pensamiento y de la toma de decisiones; participar en debates sobre temas de la propia especialidad.
- CG03 – Ser capaz de trabajar como miembro de un equipo interdisciplinar ya sea como un miembro más, o realizando tareas de dirección y desarrollo de personas con la finalidad de contribuir a desarrollar proyectos con pragmatismo y sentido de la responsabilidad, asumiendo compromisos teniendo en cuenta los recursos disponibles.
- CG04 - Ilustrar una conciencia de los problemas éticos en los negocios internacionales
- CG05 - Comunicar una sensibilización de los factores políticos, económicos, sociales y culturales que influyen en las operaciones comerciales internacionales
- CG09 – Conocer y entender la organización de una empresa y las ciencias que definen su actividad; capacidad para entender las normas laborales y las relaciones entre la planificación, las estrategias industriales y comerciales, la calidad y el beneficio.

04 Programa

- 1) Business Models como Introducción al Riesgo
- 2) El Sistema Monetario Internacional
- 3) Balanza de Pagos: Comercio, Capitales & Reservas Internacionales
- 4) Tipos de Riesgo
- 5) Toma de decisiones gerenciales: riesgos e información imperfecta
- 6) Planificación de contingencias
 - a) Productos Derivados (Forwards, Futures, Options & Swaps) para disipar riesgos Financieros (Tipos de Cambio, Commodities, Tipos de Interés)
- 7) Aplicación de la Responsabilidad Social Corporativa en la toma de decisiones y el riesgo asumido para asegurar una mejor comunidad sostenible y continuidad en la concienciación de su importancia.

o5 Metodología docente

Teniendo en cuenta la característica teórico-práctica de la y el perfil de los estudiantes, el modelo docente se articula alrededor de tres tipos de las metodologías de EAE's *Life-ED Methodology*:

- ME1.** Clase expositiva participativa
- ME3.** Trabajo autónomo
- ME4.** Aprendizaje basado en problemas y Casos
- ME7.** Evaluación

o6 Actividades formativas

Considerando las competencias de la materia y en base a las metodologías docentes propuestas, se programan las siguientes actividades formativas:

Actividades de evaluación	Horas	Presencialidad
AF1. Exposición de contenidos con participación del estudiante	24	100%
AF2. Resolución de problemas, ejercicios y casos prácticos con participación del estudiante	24	100%
AF4. Estudio y preparación de las unidades didácticas	46	0%
AF5. Realización de ejercicios y casos prácticos	25	0%
AF6. Planteamiento y resolución de problemas	25	0%
AF13. Evaluaciones escritas / orales	6	100%

o7 Evaluación

Ítem de evaluación $0.6 \cdot EV1 + 0.2 \cdot EV2 + 0.2 \cdot EV3$	Competencias específicas evaluadas	Peso
EV1. Examen final escrito de toda la materia	CEMAT01, CEMAT03, CEMAT06, CEMAT07, CEMAT08	40%
EV2. Control o prueba escrita parcial	CEMAT01, CEMAT03, CEMAT06, CEMAT07, CEMAT08	20%
EV3. Ejercicios, problemas, elaboración de informes, trabajos - Ejercicios y problemas	CEMAT01, CEMAT02, CEMAT03, CEMAT06, CEMAT07, CEMAT08, CEMAT09	40%

"La calificación máxima que los o las estudiantes podrán obtener en las pruebas de reevaluación [...] será de 5,0. Además, "la calificación de las pruebas de reevaluación constituirá, en todo caso, la calificación final de la asignatura". Así, únicamente tendrán derecho a examen aquellos estudiantes que, **habiendo cumplido con el examen parcial, el examen final y haber realizado el 100% de las actividades de evaluación continua de la asignatura**, estén suspendidos (nota final de la asignatura inferior a 5)."

One time assessment: The one time assessment consists of an exam that is equivalent to 100% of the grade of the subject. The exam, and therefore the course, is passed with a grade of 5 out of 10 in this final exam. In order to take one time assessment it is necessary to send a written request to the professor during the first 15 working days of the course.

o8 Recursos de aprendizaje

Temas	Recursos	Tipo
Temas	Transparencias, apuntes y ejercicios	Clase y Blackboard

09 Código de conducta académica

El plagio es una actividad fraudulenta cuya comisión puede conllevar graves sanciones, tanto académicas como legales. La honestidad académica es uno de los pilares en los que se sustenta el compromiso educativo de la Escuela, y los miembros de su comunidad docente están especialmente sensibilizados y preparados para detectar este tipo de acciones. Habida cuenta de la dificultad que a menudo entraña la conceptualización del plagio, se ha creído conveniente delimitar claramente su contenido y alcance en las presentes regulaciones y políticas.

Se entiende como plagio la apropiación de trabajos u obras ajenas haciéndolos pasar como propios; esto es, sin acreditar su procedencia de manera explícita. El plagio puede consistir en la copia total o parcial no autorizada de una obra ajena, o en la presentación de la copia como obra original propia, suplantando al autor verdadero. Algunos ejemplos de plagio son:

- Entregar un trabajo ajeno como si fuera propio, independientemente de que la copia sea total o parcial.
- Parafrasear un texto plasmándolo con otras palabras, pero haciendo pequeños cambios en el lenguaje para disimular y sin citar fuentes.
- Comprar o conseguir un trabajo y presentarlo como propio.
- Basarse en una idea o frase de otro u otra para escribir un trabajo nuevo sin citar al autor o a la autora de la obra.

Tal y como establece el art. 10 del Código de conducta académica del estudiantado (de EAE Barcelona o de EAE Madrid), sin perjuicio de las sanciones de carácter académico resultantes de su aplicación, la Comisión Académica promoverá las acciones legales que correspondieran en el caso de que el plagio pudiera contravenir la normativa aplicable en materia de propiedad intelectual.

10 Bibliografia

10.1 Basic bibliography

- Arena, M. P., & Julio, B. (2021). Litigation Risk Management Through Corporate Payout Policy. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, forthcoming.

-

10.2 Recommended bibliography

- Shaktawat, A., & Vadhera, S. (2021). Risk management of hydropower projects for sustainable development: a review. *Environment, Development and Sustainability*, 23(1), 45-76.
- Huy, D. T. N., Thach, N. N., Chuyen, B. M., Nhung, P. T. H., Tran, D. T., & Tran, T. A. (2021). Enhancing risk management culture for sustainable growth of Asia commercial bank-ACB in Vietnam under mixed effects of macro factors. *Entrepreneurship and Sustainability Issues*, 8(3), 291.