



Guía Docente

Datos Identificativos					2020/21
Asignatura (*)	Técnicas de cuantificación do risco de mercado	Código	611532022		
Titulación					
Descritores					
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos	
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Optativa	3	
Idioma					
Modalidade docente	Presencial				
Prerrequisitos					
Departamento	Departamento profesorado máster				
Coordinación		Correo electrónico			
Profesorado		Correo electrónico			
Web	www.usc.gal/gl/centros/ecoade/materia.html?materia=144270				
Descrición xeral	Entender diferentes medidas de risco como VaR, TailVar, Regreat ou risco sistémico. Capacidade para estimar e aplicar diferentes modelos de estimación de risco de mercado. Adquirir a capacidade para entender e desenvolver modelos con volatilidades e correlacións para valorar riscos de tipos de interese sobre un activo ou unha carteira de activos. Capacidade para aplicar diferentes técnicas de estimación do risco de crédito				
Plan de continxencia	Ver web do curso. No escenario no que se imparta docencia virtual, utilizarase a mesma aproximación metodolóxica das clases presenciais pero adaptada á contorna online. O profesor facilitará aos alumnos o material docente para o correcto seguimento das clases. Para a docencia virtual, o profesor utilizará a aula virtual e os recursos de videoconferencia que permitan unha correcta comunicación entre profesor e alumnos.				

Competencias / Resultados do título

Código	Competencias / Resultados do título
--------	-------------------------------------

Resultados da aprendizaxe

Resultados de aprendizaxe	Competencias / Resultados do título
---------------------------	-------------------------------------

Contidos

Temas	Subtemas
-------	----------

Planificación

Metodoloxías / probas	Competencias / Resultados	Horas lectivas (presenciais e virtuais)	Horas traballo autónomo	Horas totais
Atención personalizada		0		0

*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías

Metodoloxías	Descrición
--------------	------------

Atención personalizada

Metodoloxías	Descrición



Avaliación

Metodoloxías	Competencias / Resultados	Descrición	Cualificación
--------------	---------------------------	------------	---------------

Observacións avaliación

Fontes de información

Bibliografía básica
Bibliografía complementaria

Recomendacións

Materias que se recomenda ter cursado previamente

Materias que se recomenda cursar simultaneamente

Materias que continúan o temario

Observacións

(*)A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías