



Guía Docente

Datos Identificativos					2021/22
Asignatura (*)	Técnicas de cuantificación do risco de mercado	Código	611532022		
Titulación	Máster Universitario en Economía				
Descritores					
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos	
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Optativa	3	
Idioma	CastelánGalego				
Modalidade docente	Presencial				
Prerrequisitos					
Departamento	Departamento profesorado máster				
Coordinación	Reboredo Nogueira, Juan Carlos	Correo electrónico			
Profesorado	Reboredo Nogueira, Juan Carlos	Correo electrónico			
Web	www.usc.gal/gl/estudos/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia				
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	Esta materia impártese na Universidade de Santiago de Compostela. Ver a web do curso (https://www.usc.gal/gl/estudos/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia/20202021/tecnicas-cuantificacion-risco-mercado-17369-16636-3-96767).				

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