



Guía docente				
Datos Identificativos				2021/22
Asignatura (*)	Técnicas de cuantificación del riesgo de mercado	Código	611532022	
Titulación	Máster Universitario en Economía			
Descriptores				
Ciclo	Periodo	Curso	Tipo	Créditos
Máster Oficial	2º cuatrimestre	Primero	Optativa	3
Idioma	CastellanoGallego			
Modalidad docente	Presencial			
Prerrequisitos				
Departamento	Departamento profesorado máster			
Coordinador/a	Reboredo Nogueira, Juan Carlos	Correo electrónico		
Profesorado	Reboredo Nogueira, Juan Carlos	Correo electrónico		
Web	www.usc.gal/gl/estudios/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia			
Descripción general	Entender diferentes medidas de riesgo como VaR, TailVar, Regreat o riesgo sistémico. Capacidad para estimar y aplicar diferentes modelos de estimación de riesgo de mercado. Adquirir la capacidad para entender e desarrollar modelos con volatilidades y correlaciones para valorar riesgos de tipos de interés sobre un activo o una cartera de activos. Capacidad para aplicar diferentes técnicas de estimación del riesgo de crédito			
Plan de contingencia	Esta materia se imparte en la Universidade de Santiago de Compostela. Ver la web del curso (https://www.usc.gal/gl/estudios/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia/20202021/tecnicas-cuantificacion-risco-mercado-17369-16636-3-96767).			

Competencias del título	
Código	Competencias del título

Resultados de aprendizaje	
Resultados de aprendizaje	Competencias del título

Contenidos	
Tema	Subtema

Planificación				
Metodologías / pruebas	Competencias	Horas presenciales	Horas no presenciales / trabajo autónomo	Horas totales
Atención personalizada		0		0

(*) Los datos que aparecen en la tabla de planificación són de carácter orientativo, considerando la heterogeneidad de los alumnos

Metodologías	
Metodologías	Descripción

Atención personalizada	
Metodologías	Descripción

Evaluación			
Metodologías	Competencias	Descripción	Calificación



Observaciones evaluación

Fuentes de información
Básica
Complementaria

Recomendaciones
Asignaturas que se recomienda haber cursado previamente
Asignaturas que se recomienda cursar simultáneamente
Asignaturas que continúan el temario
Otros comentarios

(*) La Guía Docente es el documento donde se visualiza la propuesta académica de la UDC. Este documento es público y no se puede modificar, salvo cosas excepcionales bajo la revisión del órgano competente de acuerdo a la normativa vigente que establece el proceso de elaboración de guías