



## 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 ( <a href="https://www.usc.gal/gl/estudos/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia/20202021/tecnicas-cuantificacion-risco-mercado-17369-16636-3-96767">https://www.usc.gal/gl/estudos/masteres/ciencias-sociais-xuridicas/master-universitario-economia/20202021/tecnicas-cuantificacion-risco-mercado-17369-16636-3-96767</a> ). |                    |           |          |         |

## 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  |                     |  |                             |  |
| <table border="1"><tr><td>Bibliografía básica</td><td> </td></tr><tr><td>Bibliografía complementaria</td><td> </td></tr></table> | Bibliografía básica |  | Bibliografía complementaria |  |
| Bibliografía básica  |                     |  |                             |  |
| Bibliografía complementaria  |                     |  |                             |  |

|   |   |  |  |  |                                  |  |              |  |
|---|---|--|--|--|----------------------------------|--|--------------|--|
| Recomendacións  |   |  |  |  |                                  |  |              |  |
| <table border="1"><tr><td>Materias que se recomenda ter cursado previamente</td></tr><tr><td> </td></tr><tr><td>Materias que se recomenda cursar simultaneamente</td></tr><tr><td> </td></tr><tr><td>Materias que continúan o temario</td></tr><tr><td> </td></tr><tr><td>Observacións</td></tr><tr><td> </td></tr></table> | Materias que se recomenda ter cursado previamente |  | Materias que se recomenda cursar simultaneamente |  | Materias que continúan o temario |  | Observacións |  |
| 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