



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 / Resultados del título

Código	Competencias / Resultados del título
--------	--------------------------------------

Resultados de aprendizaje

Resultados de aprendizaje	Competencias / Resultados del título
---------------------------	--------------------------------------

Contenidos

Tema	Subtema
------	---------

Planificación

Metodologías / pruebas	Competencias / Resultados	Horas lectivas (presenciales y virtuales)	Horas 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

Evaluación



Metodoloxías	Competencias / Resultados	Descrición	Calificación
--------------	---------------------------	------------	--------------

Observacións avaliación

Fontes de información	
Básica	
Complementaria	

Recomendacións
Asignaturas que se recomenda haber cursado previamente
Asignaturas que se recomenda cursar simultaneamente
Asignaturas que continúan o 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