



Guía docente

Datos Identificativos					2022/23
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	juan.carlos.reboredo@col.udc.es		
Profesorado	Reboredo Nogueira, Juan Carlos	Correo electrónico	juan.carlos.reboredo@col.udc.es		
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				

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