



Guía Docente

Datos Identificativos					2023/24
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	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				
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				

Competencias do título

Código	Competencias do título
--------	------------------------

Resultados da aprendizaxe

Resultados de aprendizaxe	Competencias do título
---------------------------	------------------------

Contidos

Temas	Subtemas
-------	----------

Planificación

Metodoloxías / probas	Competencias	Horas presenciais	Horas non presenciais / 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	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