



## 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