



Guía Docente				
Datos Identificativos				2020/21
Asignatura (*)	Técnicas de cuantificación do risco de mercado		Código	611532022
Titulación	Máster Universitario en Economía			
Descriptoros				
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Optativa	3
Idioma				
Modalidade docente	Presencial			
Prerrequisitos				
Departamento	Departamento profesorado máster			
Coordinación		Correo electrónico		
Profesorado		Correo electrónico		
Web	www.usc.gal/gl/centros/ecoadde/materia.html?materia=144270			
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	Ver web do curso. No escenario no que se imparta docencia virtual, utilizarase a mesma aproximación metodolóxica das clases presencias pero adaptada á contorna online. O profesor facilitará aos alumnos o material docente para o correcto seguimento das clases. Para a docencia virtual, o profesor utilizará a aula virtual e os recursos de videoconferencia que permitan unha correcta comunicación entre profesor e alumnos.			

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