



| Guía Docente          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                    |                                 |           |
|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------------------|-----------|
| Datos Identificativos |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                    |                                 | 2022/23   |
| Asignatura (*)        | Técnicas de cuantificación do risco de mercado                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                    | Código                          | 611532022 |
| Titulación            | Máster Universitario en Economía                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                    |                                 |           |
| Descriptor            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                    |                                 |           |
| 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.<br>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 de acordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías