

**FICHA IDENTIFICATIVA****Datos de la Asignatura**

Código	42209
Nombre	Trabajo de investigación
Ciclo	Máster
Créditos ECTS	30.0
Curso académico	2021 - 2022

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	Facultad de Economía	2	Anual

Materias

Titulación	Materia	Caracter
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	3 - Trabajo fin de máster	Trabajo Fin Estudios

Coordinación

Nombre	Departamento
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economía Financiera y Actuarial

RESUMEN

El objetivo del trabajo de investigación es que los estudiantes plasmen los conocimientos adquiridos en los cinco trimestres anteriores y sean capaces de:

- Elegir un tema de investigación de interés, bien para el área profesional o para la académica y,
- Abordarlo tanto en su vertiente teórica como empírica, haciendo uso de los instrumentos aprendidos en el desarrollo de las diferentes asignaturas del programa.
- Bajo la dirección de un tutor que dirige y valora el trabajo, los estudiantes eligen el tema de su trabajo y para ello se establecen tres líneas de investigación básicas:



Línea de investigación en **Banca**

El trabajo deberá consistir en la utilización de herramientas analíticas y prácticas para la correcta gestión del riesgo en la actividad bancaria: estudio de las técnicas de concesión de crédito, análisis de los diferentes tipos de riesgo (de crédito, de tipo de interés, de mercado, de liquidez, tecnológico y de tipo de cambio y riesgo país).

Línea de investigación en **Finanzas**

El trabajo deberá consistir en analizar la teoría y la evidencia empírica de la valoración de activos, mediante la unificación del tratamiento de los modelos teóricos de valoración de activos a través del factor de descuento estocástico.

Línea de investigación en **Métodos Cuantitativos para las Finanzas**

El trabajo deberá consistir en formalizar un problema cuantitativo novedoso en finanzas como un problema numérico que pueda ser resuelto con ayuda del ordenador, mediante la utilización de un lenguaje de programación orientado al cálculo numérico para implementar algoritmos capaces de resolver dichos problemas.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

Otros tipos de requisitos

COMPETENCIAS

RESULTADOS DE APRENDIZAJE

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS



VOLUMEN DE TRABAJO

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	300,00	100
TOTAL	300,00	

METODOLOGÍA DOCENTE

EVALUACIÓN

La evaluación del trabajo de investigación se basa en la calidad académica y la pública presentación del mismo. Para ello, el Programa organiza el llamado Workshop en Finanzas Cuantitativas a finales del mes de junio, donde los estudiantes presentan públicamente durante 45-60 minutos sus trabajos y se elige un comentarista de reconocido prestigio en el área que lo discute y propone, en su caso, líneas de mejora. Para su valoración se tiene en cuenta la validez del enfoque realizado, la aplicación de metodología apropiada, ... En todo caso, será necesario haber superado 90 créditos del resto de asignaturas, incluyendo los 60 créditos de asignaturas obligatorias de primer curso y al menos 30 créditos de optativas de segundo curso, para poder realizar el depósito y defensa del trabajo fin de máster.

REFERENCIAS

Básicas

- Biblioteca y Centro de Cálculo de la Facultad. Bases de datos disponibles en la propia biblioteca de la Facultad, o puestas a su disposición por los profesores del programa.

ADENDA COVID-19

Esta adenda solo se activará si la situación sanitaria lo requiere y previo acuerdo del Consejo de Gobierno

En caso de tener que suspenderse la actividad presencial, el programa se reorganizará para poder continuar online con el desarrollo del Máster, manteniendo la calidad y el rigor tanto de las clases como de los métodos de evaluación. La Comisión Académica valorará la conveniencia de modificar la forma de evaluación de las asignaturas y cualquier posible cambio será anunciado al alumnado a la mayor brevedad posible.