

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	42209
Nom	Treball d'investigació
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	30.0
Curs acadèmic	2023 - 2024

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	Facultat d'Economia	2	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	3 - Treball fi de màster	Treball Fi Estudis

Coordinació

Nom	Departament
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economia Financera i Actuarial

RESUM

L'objectiu del treball de recerca és que els estudiants plasmen els coneixements adquirits en els cinc trimestres anteriors i siguin capaços de:

- Triar un tema d'investigació d'interès, bé per a l'àrea professional o per l'acadèmica i,
- Abordar tant en el seu vessant teòric com empíric, fent ús dels instruments apresos en el desenvolupament de les diferents assignatures del programa.
- Sota la direcció d'un tutor que dirigeix i valora el treball, els estudiants trien el tema del seu treball i per a això s'estableixen tres línies de recerca bàsiques:

Línia de recerca en **Banca**



El treball haurà de consistir en la utilització d'eines analítiques i pràctiques per a la correcta gestió del risc en l'activitat bancària: estudi de les tècniques de concessió de crèdit, anàlisi dels diferents tipus de risc (de crèdit, de tipus d'interès, de mercat, de liquiditat, tecnològic i de tipus de canvi i risc país).

Línia de recerca en **Finances**

El treball ha de consistir en analitzar la teoria i l'evidència empírica de la valoració d'actius, mitjançant la unificació del tractament dels models teòrics de valoració d'actius a través del factor de descompte estocàstic.

Línia d'investigació en **Mètodes Quantitatius per a les Finances**

El treball ha de consistir en formalitzar un problema quantitatiu nou en finances com un problema numèric que pugui ser resolt amb ajuda de l'ordinador, mitjançant la utilització d'un llenguatge de programació orientat al càlcul numèric per implementar algorismes capaços de resoldre aquests problemes.

CONEIXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

COMPETÈNCIES

RESULTATS DE L'APRENENTATGE

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS



VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	300,00	100
TOTAL	300,00	

METODOLOGIA DOCENT

AVALUACIÓ

L'avaluació del treball de recerca es basa en la qualitat acadèmica i la pública presentació del mateix. Per això, el Programa organitza l'anomenat Workshop en Finances Quantitatives a finals del mes de juny, on els estudiants presenten públicament durant 45-60 minuts els seus treballs i es tria un comentarista de reconegut prestigi en l'àrea que ho discuteix i proposa, si cas, línies de millora. Per a la seva valoració es té en compte la validesa de l'enfocament realitzat, l'aplicació de metodologia apropiada,...En tot cas, serà necessari haver-hi superat 90 crèdits per a poder realitzar el dipòsit i defensa del treball. Aquests 90 crèdits superats consistiran en la totalitat de les assignatures de primer curs i almenys 30 crèdits corresponents a les assignatures optatives de segon curs.

REFERÈNCIES

Bàsiques

- 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.