



FICHA TÉCNICA DE LA ASIGNATURA

Datos de la asignatura	
Nombre completo	Trabajo fin de master
Código	E000002304
Título	Máster Universitario en Gestión de Riesgos Financieros
Impartido en	Máster Universitario en Gestión de Riesgos Financieros [Primer Curso]
Nivel	Postgrado Oficial Master
Cuatrimestre	Semestral
Créditos	6,0 ECTS
Carácter	Prueba Final Máster
Departamento / Área	Máster Universitario en Gestión de Riesgos Financieros
Responsable	Susana Carabias López

Datos del profesorado

DATOS ESPECÍFICOS DE LA ASIGNATURA

Contextualización de la asignatura

Aportación al perfil profesional de la titulación

El Trabajo fin de Máster es un proyecto personal en el que el alumno debe demostrar que domina un tema y sabe organizarlo, estructurarlo y presentarlo, conforme a las especificaciones propias de un trabajo académico científico.

El desarrollo del Trabajo Fin de Máster aporta al alumno un contexto en el que debe hacer uso de las competencias desarrolladas a lo largo del programa docente y que serán imprescindibles para el ejercicio profesional.

Por esta razón se verá obligado a fortalecer estas competencias y aumentará su capacitación para implementarlas correctamente en el ejercicio profesional.

Prerequisitos

Para entregar y defender el Trabajo Fin de Máster, es imprescindible que el alumno haya superado todas las asignaturas con docencia del programa, demostrando así que posee los conocimientos y competencias mínimas exigidas.

El tema debe ser relevante, estar situado en el campo de la Gestión de riesgos financieros y ser aceptado por la coordinación.

Competencias - Objetivos



Competencias

GENERALES

CGI01	Capacidad de análisis y síntesis	
	RA1	Describir, relacionar e interpretar situaciones y planteamientos teóricos y prácticos en el marco de la gestión de riesgos
	RA2	Seleccionar y analizar los elementos más significativos y sus relaciones en contextos diferentes
	RA3	Identificar las carencias de información y la relevancia de la misma, estableciendo relaciones con elementos externos a la situación planteada
	RA4	Realizar análisis con la profundidad y coherencia necesarios para servir de apoyo en la toma de decisiones empresariales con impacto.
CGI02	Capacidad de gestionar información proveniente de fuentes diversas	
	RA1	Conocer, utilizar y discriminar las fuentes de información sobre la materia (información registrada en los mercados (difusores de información, páginas web, revistas especializadas, informes de analistas y otras) mostrando profundidad en la base de sus análisis y precisión en los datos utilizados.
	RA2	Identificar la idoneidad de cada fuente y estudio en función de la finalidad de la misma, dando rigor a las opiniones y conclusiones tomadas
CGI04	Capacidad de organización, planificación y gestión del tiempo	
	RA1	Planifica su trabajo personal de una manera viable y sistemática, teniendo en cuenta un plan de trabajo organizado en tiempo y calidad.
	RA2	Se integra y participa en el desarrollo organizado de un trabajo en grupo, aprendiendo a compartir conocimientos, habilidades y responsabilidades
	RA3	Desarrolla la capacidad de negociación y planificación de resultados y objetivos
CGI05	Conocimientos avanzados de informática aplicada al ámbito de estudio	
	RA1	Usar herramientas informáticas para generar documentos (gráficos, tablas, otros) que ilustren y clarifiquen argumentos.
	RA2	Usar programas informáticos básicos para la elaboración y presentación de trabajos, informes, etc.



	RA3	Emplear medios audiovisuales como apoyo a las presentaciones orales
	RA4	Utilizar Internet y bases de datos financieros online en la búsqueda de información y documentación relacionada con el área de riesgos
CGP09	Capacidad crítica y autocrítica	
	RA1	Identificar, establecer y contrastar las hipótesis, variables y resultados de manera lógica y crítica
	RA2	Revisar las opciones y alternativas con un razonamiento crítico que permita discutir y argumentar opiniones contrarias.
CGS13	Iniciativa y espíritu emprendedor	
	RA1	Es capaz de desarrollar determinadas actitudes intelectuales que predispongan a la generación de nuevas oportunidades de negocio
	RA2	Comprensión y profundización en el concepto de riesgo y su tipología desde una perspectiva empresarial
	RA3	Percepción de la importancia de la función de la gestión de riesgos en la empresa
	RA4	Conocimiento y comprensión de los productos financieros complejos y específicos empleados en la gestión de riesgos y de las particularidades de los mercados en los que se negocian
	RA5	Conocimiento de los modelos estadísticos avanzados relacionados con el análisis de los riesgos
	RA6	Dominio de las medidas de riesgo más utilizadas y sus propiedades
	RA7	Conocimiento y aplicación de las principales herramientas estadísticas avanzadas de análisis de datos
	RA8	Conocimiento y aplicación de los modelos estadísticos de regresión lineal múltiple
	RA9	Conocimiento de los modelos clásicos de valoración de activos financieros de renta variable
	RA10	Conocimiento y correcta aplicación de los principios de valoración y gestión de carteras de renta fija
	RA11	Conocimiento y correcta aplicación de los principios de valoración de activos derivados
		Conocimiento de los conceptos y las herramientas propias del análisis de series



RA12	Conocimiento de los conceptos y los procedimientos propios del análisis de series temporales y de los modelos de volatilidad estocástica
RA13	Profundización en el concepto de riesgo de mercado y dominio de los métodos de cálculo más utilizados en la práctica profesional.
RA14	Conocimiento del concepto de riesgo de liquidez y dominio de los métodos de cálculo más utilizados en la práctica profesional
RA15	Profundización en el concepto de riesgo de crédito y dominio de los métodos de cálculo más utilizados en la práctica profesional
RA16	Profundización en el concepto de riesgo operativo, estratégico y legal y dominio de los métodos de cálculo más utilizados en la práctica profesional
RA17	Capacidad de integrar la estrategia global de la empresa con la de gestión del riesgo extrayendo sus efectos sobre las diferentes áreas funcionales
RA18	Conocimiento y manejo del software específico avanzado de análisis de la información necesaria para llevar a cabo una gestión profesional del riesgo
RA19	Identificación de posibles problemas éticos planteados en el entorno empresarial y justificación de la mejor solución aplicable
RA20	Conocimiento y comprensión de los conceptos básicos relativos al seguro y mercado asegurador

BLOQUES TEMÁTICOS Y CONTENIDOS

METODOLOGÍA DOCENTE

Aspectos metodológicos generales de la asignatura

Metodología Presencial: Actividades

Seminarios

Su propósito será la exposición de las indicaciones para la realización del Trabajo fin de Máster (normas, requisitos, proceso y fases, diseño de una investigación académica, fechas relevantes y forma de evaluación, entre otros aspectos)

Se lleva a cabo un seguimiento del desarrollo de los proyectos de los estudiantes, que permitan identificar dudas comunes a todos los estudiantes involucrados en la realización del trabajo para definir la temática de los seminarios que se consideren necesarios.



Sesiones tutoriales

El profesor tutor llevará a cabo sesiones tutoriales con el alumno con el fin de orientarle, guiarle y supervisarle en el proceso de elaboración de su Trabajo fin de Máster.

Metodología No presencial: Actividades

Estudio individual que el estudiante realiza para comprender, elaborar y retener un contenido científico con vistas a una posible aplicación en el ámbito de su proyecto de investigación.

Lectura individual de textos de diferente tipo (libros, revistas, artículos sueltos, prensa, publicaciones en Internet, informes sobre experiencias prácticas, etc.) relacionados con el objeto de estudio definido en su proyecto de investigación.

Redacción por escrito de una monografía sobre la temática concreta elegida que evidencie las competencias adquiridas en las distintas asignaturas del máster.

RESUMEN HORAS DE TRABAJO DEL ALUMNO

HORAS PRESENCIALES		
Sesiones tutoriales	Reuniones de alumnos y coordinador TFM	Seminarios y talleres (casos prácticos)
5.00	3.00	2.00
HORAS NO PRESENCIALES		
Estudio y ampliación bibliográfica de contenidos	Monografía de carácter teórico y/o práctico	
90.00	60.00	
CRÉDITOS ECTS: 6,0 (160,00 horas)		

EVALUACIÓN Y CRITERIOS DE CALIFICACIÓN

Actividades de evaluación	Criterios de evaluación	Peso
Evaluación de la monografía individual	<ul style="list-style-type: none">Objetivos del proyectoMetodologíaFuentes utilizadasProfundidad del análisisResultados y conclusiones obtenidosMadurez de juicioPresentación física	60



Presentación y defensa	<ul style="list-style-type: none">· Identificación del objeto de la investigación· Justificación de su relevancia científica y empresarial· Exposición de la metodología utilizada en el proceso de investigación· Principales resultados alcanzados como fruto del proyecto de investigación· Comunicación clara de las conclusiones	40
------------------------	---	----

BIBLIOGRAFÍA Y RECURSOS

Bibliografía Básica

Libros

García, J. I., Garrido, R. y Hernández, N. (2003). *Libro de estilo*. Madrid: Universidad Pontificia Comillas

Muñoz-Alonso, G. (2011) *Estructura, metodología y escritura del Trabajo Fin de Máster*. Madrid: Escolar y Mayo Editores

Otros materiales

Rodríguez, M.L. y Llanes, J. (coords.) (2013) *Cómo elaborar, tutorizar y evaluar un Trabajo Fin de Máster*. Agència per a la Qualitat del Sistema Universitari de Catalunya

Páginas web

Biblioteca Universidad Pontificia Comillas <http://www.upcomillas.es/es/alumnos/vida-en-el-campus/biblioteca>

Buscadores Académicos

[Google Scholar](#)

[Microsoft Academic Search](#)

En cumplimiento de la normativa vigente en materia de **protección de datos de carácter personal**, le informamos y recordamos que puede consultar los aspectos relativos a privacidad y protección de datos [que ha aceptado en su matrícula](#) entrando en esta web y pulsando "descargar"

[https://servicios.upcomillas.es/sedelectronica/inicio.aspx?csv=02E4557CAA66F4A81663AD10CED66792](https://servicios.upcomillas.es/sedeelectronica/inicio.aspx?csv=02E4557CAA66F4A81663AD10CED66792)