Cuando trabajamos en Visual Studio Code y cerramos la aplicación sin darle a «Guardar los cambios» hace que la ventana de Code se cierre. Con respectos los datos, tranquilos que no pasa nada: no los hemos perdido. Si volvemos a abrir Code, veremos que el archivo está ahí, con los cambios sin guardar. Pero si estamos acostumbrados a cerrar las aplicaciones cuando concluimos nuestro trabajo, y queremos que la aplicación en cuestión nos ofrezca guardar los datos, nos cabrearemos mucho con este comportamiento de VSC. Lo arreglamos así:

Vamos al menú «Archivo» > «Preferencias» > «Configuración» y en «Buscar configuración» escribimos el texto «files.hotExit» (sin las comillas).

Se nos abrirá la sección de cierre en caliente, ahí marcamos «off» y cerramos la sección.