

Propuesta de Trabajos Fin de Grado, curso académico 2024-25

PROFESOR:

Número máximo de TFG que solicita dirigir: 1

1.- TEMA: Medidas de riesgo para finanzas y seguros

Válido para **1 alumno**.

Resumen/contenido: En los últimos años se ha producido un cambio en las medidas usadas para calcular el riesgo asumido por las empresas, tanto en los mercados financieros como en el mundo asegurador. Se ha pasado de estimadores de percentiles altos de la distribución de pérdidas en una dimensión a planteamientos más complejos, como el expected shortfall en dimensionalidad arbitraria.

El objeto de este trabajo es el adquirir los conocimientos propios de estos enfoques metodológicos.

Requisitos: Probabilidad II (se valorará Estadística II). Programación, preferentemente en Python. Economía y finanzas matemáticas.

Asignaturas de cuarto relacionadas/compatibles:

Bibliografía/referencias:

- Risk measures for the XXI Century; ed Giorgio Szegö. Wiley Finance.
- Coherent risk measures; Artzner et al. Math Finance 9 (3). 203-228.