

ÍNDICE DE CONTENIDOS

RESUMEN EJECUTIVO	2
2 INTRODUCCIÓN	5
2.1 PROBLEMAS Y MOTIVACIÓN	5
2.2 OBJETIVOS.....	6
2.2.1 OBJETIVO GENERAL.....	6
2.2.2 OBJETIVOS ESPECÍFICOS	6
2.3 CONTRIBUCIÓN DE LA TESIS.....	7
2.4 METODOLOGÍA Y HERRAMIENTAS.....	7
2.5 RESULTADOS Y CONCLUSIONES	8
3 CUANTIFICANDO EL IMPACTO DE LOS EVENTOS EXTREMOS EN MONEDAS DE PRODUCTOS BÁSICOS.....	9
3.1 Introducción	10
3.2 Revisión bibliográfica.....	11
3.3 Metodología	13
3.3.1 Teoría de Valores Extremos.....	13
3.3.2 <i>Peaks Over Threshold</i>	14
3.3.3 Hawkes- <i>POT</i> multivariado.....	16
3.3.4 Valor en Riesgo y medidas de ajuste	17
3.4 Análisis empírico	20
3.4.1 Descripción de los Datos	20
3.4.2 Elección del Umbral.....	21
3.4.3 Configuración de los modelos	22
3.4.4 Resultados del ajuste de los modelos.....	22
3.4.5 <i>In Sample and Out of Sample Value-at-Risk</i>	24
4 CONCLUSIONES.....	27
5 ANEXOS	28
6 BIBLIOGRAFÍA	36

ÍNDICE DE TABLAS

Tabla A. 1	28
Tabla A. 2	28
Tabla A. 3	29
Tabla A. 4	30
Tabla A. 5	31
Tabla A. 6	32
Tabla A. 7	33
Tabla A. 8	34