

## Índice

<b>1. Introducción</b>	<b>1</b>
1.1. Preguntas de investigación . . . . .	2
1.2. Objetivos . . . . .	3
1.2.1. Objetivos general . . . . .	3
1.2.2. Objetivos específicos . . . . .	3
<b>2. Marco teórico</b>	<b>4</b>
2.1. Teoría de Valores Extremos . . . . .	4
2.1.1. Distribución Generalizada de Valores Extremos . . . . .	4
2.1.2. Distribución Generalizada de Pareto . . . . .	4
2.2. Procesos Puntuales . . . . .	5
<b>3. Métodos</b>	<b>7</b>
3.1. Score-driven Peak Over Threshold framework . . . . .	7
3.2. Generalized Score-driven Peak over Threshold framework . . . . .	7
<b>4. Descripción de las publicaciones</b>	<b>9</b>
4.1. Modeling Extreme Risks in Commodities and Commodity Currencies . . . . .	9
4.2. Dynamics of Connectedness in Clean Energy Stock Markets . . . . .	10
4.3. Forecasting Extreme Financial Risk: A Score-driven Approach . . . . .	11
4.4. Assessing Systemic Risk with Score-driven Extreme Value Models . . . . .	12
<b>5. Conclusiones</b>	<b>14</b>
5.1. Principales Contribuciones y Conclusiones . . . . .	14
5.2. Limitaciones . . . . .	14
5.3. Futuras Investigaciones . . . . .	15
<b>Apéndice A</b> <b>Modeling Extreme Risks in Commodities and Commodity Currencies</b>	<b>21</b>
<b>Apéndice B</b> <b>Dynamics of Connectedness in Clean Energy Stock Markets</b>	<b>35</b>
<b>Apéndice C</b> <b>Forecasting Extreme Financial Risk: A Score-driven Approach</b>	<b>54</b>
<b>Apéndice D</b> <b>Assessing Systemic Risk with Score-driven Extreme Value Models</b>	<b>106</b>