

Gestión de riesgos financieros

1. Teoría del riesgo actuarial.
 - Proceso de siniestros.
 - Teoría de ruina.
 - Primas.
2. Modelación y medición del riesgo financiero
 - Riesgo de crédito.
 - Riesgo de mercado.
 - Riesgo de balance.
3. Capital y solvencia.
 - Asignación de capital.
 - Margen de solvencia.

Referencias.

Mikosch. Non-life insurance. Springer

Embrechts et al. Quantitative Risk Management. Princeton UP

Buhlman. Mathematical methods in risk theory. Springer.