

Propuesta de Trabajos Fin de Grado, curso académico 2022-23

PROFESOR/A: Santiago Carrillo Menéndez

Número máximo de TFG que solicita dirigir: 1 (entre 1 y 4)

1.- **TÍTULO:** Distribuciones de colas pesadas y sus aplicaciones

Resumen/contenido: numerosos fenómenos se modelizan mediante distribuciones con colas pesadas (más pesadas que las de la normal): medición de riesgos (finanzas, seguros) o tiempos de espera en Internet, por poner dos ejemplos. El TFG propuesto consiste en el estudio de las distintas familias de distribuciones con colas pesadas así como el de su uso en modelización (con énfasis en los problemas de calibración y bondad de ajuste).

Bibliografía/referencias:

- Modelling Extremal Events for Insurance and Finance. Embrechts, Küppelberg, Mikosch. Springer Verlag Heidelberg (1997).
- Statistical Analysis of Extreme Values; R.D.Reiss, M. Thomas. Birkhauser 1991.
- Regular Variation, Subexponentiality and Their Applications in Probability Theory. T. Mikosch (<https://www.eurandom.tue.nl/reports/1999/013-report.pdf>).

Válido para más de un estudiante: (sí/no)