

INDICE

INDICE	5
INTRODUCCIÓN	8
CAPÍTULO I. RIESGO, SEGURO Y SOLVENCIA DE LAS ENTIDADES ASEGURADORAS.	17
1. INTRODUCCIÓN	17
2. EL RIESGO Y EL SEGURO	19
3. VALORACIÓN DE LA SOLVENCIA EN LAS ENTIDADES ASEGURADORAS.	29
CAPÍTULO II. LA TEORÍA DEL VALOR EXTREMO: ORIGEN, APORTACIONES Y FUNDAMENTOS.	43
1. ORIGEN DE LA TEORÍA DEL VALOR EXTREMO, EVOLUCIÓN HISTÓRICA Y APORTACIONES FUNDAMENTALES.	44
2. CONTRIBUCIÓN DE LA TEORÍA DEL VALOR EXTREMO A LA TEORÍA CLÁSICA DEL RIESGO EN RELACIÓN CON LA GESTIÓN DEL RIESGO EN LAS ENTIDADES ASEGURADORAS.	51
3. FUNDAMENTOS DE LA TEORÍA DEL VALOR EXTREMO	56
CAPÍTULO III. ESTUDIO EMPÍRICO: APLICACIÓN DE LA TEORÍA DEL VALOR EXTREMO A UNA CARTERA DE SINIESTROS DE RESPONSABILIDAD CIVIL DEL RAMO DE AUTOMÓVILES.	129
1. INTRODUCCIÓN	130
2. DESCRIPCIÓN DE LAS BASES DE DATOS	134
3. PRIMERA APROXIMACIÓN A LOS SINIESTROS EXTREMOS	140
4. AJUSTE DE LA DISTRIBUCIÓN GENERALIZADA DE PARETO A LOS SINIESTROS EXTREMOS	186
5. LA FRECUENCIA DE VALORES EXTREMOS SEGÚN EL MÉTODO DE GUMBEL	238
CAPÍTULO IV. FUTURAS LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN	247
1. FUTUROS ANÁLISIS RELATIVOS A LA INVESTIGACIÓN ASINTÓTICO – MATEMÁTICA:	248
2. FUTURAS LÍNEAS DE INVESTIGACIÓN RELATIVAS A SU APLICACIÓN FINANCIERA – ACTUARIAL.	250

CONCLUSIONES	267
BIBLIOGRAFÍA	273
ENLACES DE INTERÉS	277
ANEXO I. LA TEORÍA DEL RIESGO CLÁSICA PARA EL ESTUDIO DE LOS RIESGOS DE MASA	279
1. LEY DE LOS GRANDES NÚMEROS Y TEOREMA CENTRAL DEL LÍMITE.	279
2. LA DISTRIBUCIÓN DEL DAÑO TOTAL	282
ANEXO II. NORMAS INTERNACIONALES DE SOLVENCIA: SOLVENCIA II	293
1. INTRODUCCIÓN	293
2. EL NUEVO RÉGIMEN DE SOLVENCIA	301
3. Principales documentos de trabajo	308
ANEXO III: ACERCA DEL SOFTWARE XTREMES	311
ANEXO IV: TABLAS SOBRE FRECUENCIA DE SINIESTRALIDAD GRAVE	313
ANEXO V: FRECUENCIA DE SINIESTRALIDAD EXTREMA SEGÚN EL MÉTODO DE GUMBEL	325