

Anexo I. Registro del Título del Trabajo Fin de Grado (TFG)

NOMBRE DEL ALUMNO: **Cristina Díez Buisán**

PROGRAMA: **2024-2025**

GRUPO: **4ºE2**

FECHA: **22/10/2024**

Director Asignado: **Figuerola Ferretti**

Apellidos

Isabel

Nombre

Título provisional del TFG:

Análisis del riesgo geopolítico y climático en los precios del petróleo
utilizando la herramienta VLAB de NYU Stern School of Business

ADJUNTAR PROPUESTA (máximo 2 páginas: objetivo, bibliografía, metodología e índice preliminares)

Firma del estudiante:



Fecha: **22/10/2024**

Título Provisional:

Análisis del Riesgo Geopolítico y Riesgo Climático en los Precios del Petróleo utilizando la Herramienta VLAB de NYU Stern School of Business

1. Introducción

El sector del petróleo enfrenta un entorno complejo marcado por riesgos geopolíticos y climáticos. Estos riesgos no solo afectan la producción y distribución del petróleo, sino también su volatilidad en los mercados internacionales. Este trabajo de fin de grado tiene como objetivo analizar el impacto que estos riesgos tienen sobre los precios del petróleo, utilizando herramientas como el VLAB (NYU Stern) para medir la volatilidad y el índice de riesgo geopolítico (GPR).

El estudio se centrará en cómo los eventos geopolíticos y climáticos influyen en la volatilidad del precio del petróleo, tomando como base ejemplos históricos y datos actuales. La investigación se desarrollará mediante modelos econométricos, análisis de regresión y herramientas avanzadas como VLAB y Policy Uncertainty.

2. Objetivos

- Analizar la relación entre el riesgo geopolítico y climático y la volatilidad de los precios del petróleo.
- Medir la influencia de estos riesgos utilizando el Índice de Riesgo Geopolítico (GPR) y la herramienta VLAB de NYU Stern.
- Desarrollar modelos de regresión que permitan cuantificar cómo los eventos geopolíticos y climáticos impactan en los precios del petróleo.

3. Metodología Provisional

La metodología propuesta se basa en un enfoque cuantitativo para analizar la relación entre los riesgos y los precios del petróleo, empleando datos históricos y herramientas analíticas.

- **Herramientas de Análisis:**
 - **Índice de Riesgo Geopolítico (GPR):** se utilizará el Índice de Riesgo Geopolítico (GPR). Este índice mide los eventos geopolíticos adversos a través del análisis de artículos de prensa desde 1985.
 - **VLAB (NYU Stern School of Business):** Se empleará para medir la volatilidad del sector petrolero y observar cómo esta volatilidad reacciona a los picos en el GPR y a eventos climáticos adversos.

- **Índice de Incertidumbre de Políticas (Policy Uncertainty):** Para complementar el análisis de riesgo geopolítico, se utilizará este índice, que captura la incertidumbre asociada a eventos políticos y geopolíticos.

4. Bibliografía

- The Volatility Laboratory. (s. f.). *Real-time financial volatility, correlation, and risk measurement, modeling, and forecasting*. <https://vlab.stern.nyu.edu/>
- *Economic Policy uncertainty index*. (s. f.). <https://www.policyuncertainty.com/gpr.html>
- Caldara, D., & Iacoviello, M. (2022). Measuring geopolitical risk. *American Economic Review*, 112(4), 1194–1225. <https://doi.org/10.1257/aer.20191823>