

Índice general

Acerca del autor	7
Prólogo	8
Prefacio	10
1 Introducción	11
2 Algunos conceptos previos	18
2.1 Vectores aleatorios	19
2.2 Función de distribución	20
2.3 Función de densidad	24
2.4 Función cuantil	26
2.5 Independencia, comonotonía y antimonotonía .	28
2.6 Cotas de Fréchet-Hoeffding	37
3 Dependencia	40
3.1 Introducción	41
3.2 Dependencia positiva	43
3.3 Dependencia negativa	77
3.4 Medidas de dependencia	86

4	Teoría de cópulas	110
4.1	Definición	111
4.2	Teorema de Sklar	114
4.3	Cópula de supervivencia	122
5	Algunos modelos de cópulas	124
5.1	Clasificación	125
5.2	Cópulas límite o fundamentales	126
5.3	Cópulas elípticas	130
5.4	Cópulas arquimedianas	141
5.5	Cópulas de valores extremos	161
5.6	Cópulas HRT	165
5.7	Cópulas arquimax	166
6	Estimación	168
6.1	Cópula empírica	169
6.2	Estimación paramétrica	171
	Bibliografía	173