



1. DATOS BÁSICOS DEL TFG:

Título: Cópulas y cuasicópulas

Descripción general (resumen y metodología):

El concepto de cópula es debido a Abe Sklar en 1959. Desde entonces la teoría de cópulas se ha desarrollado y se ha aplicado a diversas disciplinas, como la teoría de la probabilidad y la estadística matemática, las ciencias actuariales y la economía, entre otras.

La teoría de cuasicópulas surgió en 1993, y ha tenido desde ese momento un notable desarrollo.

Tipología: Trabajos bibliográficos sobre el estado actual de una temática relacionada con el Grado.

Objetivos planteados:

En este trabajo fin de grado se pretende que el alumno estudie en profundidad los conceptos, propiedades y primeros resultados de la teoría de cópulas y cuasicópulas.

Bibliografía básica:

- [1] F. Durante, C. Sempi. Principles of Copula Theory. Chapman & Hall/CRC, Boca Raton, FL. 2016.
- [2] C. Genest, J.J. Quesada-Molina, J.A. Rodríguez-Lallena, C. Sempi. "A characterization of quasi-copulas". J. Multivariate Anal. 69 (1999) 193-205.
- [3] R.B. Nelsen. An Introduction to Copulas. Second Edition, Springer, New York, 2006.
- [4] R.B. Nelsen, J.J. Quesada-Molina, J.A. Rodríguez-Lallena. "Bivariate copulas with cubic sections". J. Nonparametric Statist. 7 (1997) 205-220.
- [5] J.J. Quesada-Molina, J.A. Rodríguez-Lallena. "Bivariate copulas with quadratic sections". J. Nonparametric Statist. 5 (1995) 323-337.
- [6] B. Schweizer, A. Sklar, Probabilistic Metric Spaces. Elsevier-North Holland, New York, 1983.
- [7] A. Sklar. "Fonctions de repartition à dimensions et leurs marges". Publ. Inst. Statist. Univ. Paris 8 (1959), 229-231.

Recomendaciones y orientaciones para el estudiante:

Plazas: 1

2. DATOS DEL TUTOR/A:

Nombre y apellidos: JOSÉ JUAN QUESADA MOLINA

Ámbito de conocimiento/Departamento: MATEMÁTICA APLICADA

Correo electrónico: jquesada@ugr.es

3. COTUTOR/A DE LA UGR (en su caso):

Nombre y apellidos:

Ámbito de conocimiento/Departamento:

Correo electrónico:

4. COTUTOR/A EXTERNO/A (en su caso):

Nombre y apellidos:

Correo electrónico:

Nombre de la empresa o institución:

Dirección postal:

Puesto del tutor en la empresa o institución:

Centro de convenio Externo:

5. DATOS DEL ESTUDIANTE:

Nombre y apellidos: José Antonio Bustos Ciudad

Correo electrónico: joseanbustos04@correo.ugr.es