

Litteraturlista för MASM33, Matematisk statistik: Kvantitativ riskanalys med Copulas gällande från och med höstterminen 2021

Litteraturlistan är fastställd av Naturvetenskapliga fakultetens utbildningsnämnd 2020-12-01 att gälla från och med 2020-12-01

Mai, J. & Scherer, Matthias.(2012). *Simulating copulas: stochastic models, sampling algorithms and applications*. London: World Scientific.

ISBN: 9781848168749

Beirlant, J., Goegebur, Yuri., Teugels, Jozef., Segers, Johan., Waal, Daniel de. & Ferro, Chris.(2004). *Statistics of extremes theory and applications*. Chichester: J. Wiley.

ISBN: 9780470012383