

Lista 2

- Calcule a média da distribuição GPD e use essa informação para mostrar que a mean excess function, $e(\ell)$, é linear em ℓ .
- Problemas 2.2, 2.3, 2.4 (itens 1, 2 e 3), 2.6, 2.8 da referência.

Referência: Carmona, René. Statistical analysis of financial data in R, 2013.