
JAYDE EUSTACE, Memorial University of Newfoundland
Modèle à espace d'états de Gumbel pour des valeurs extrêmes

La théorie des valeurs extrêmes offre plusieurs applications dans des domaines tels que la météorologie, la finance et l'ingénierie. Au cours des dernières années, l'intérêt a repris concernant l'analyse de séries de valeurs extrêmes. Dans cet exposé, certaines propriétés des mélanges de Gumbel et des variables aléatoires α -stables sont utilisées pour construire un modèle à espace d'états avec des lois marginales de type Gumbel. La densité des variables aléatoires α -stables ne peut pas être exprimée sous forme analytique et leur espérance n'existe pas. Cet aspect pose des défis en matière d'inférence. Les méthodes proposées sont comparées aux modèles actuels par des simulations avec des données réelles.