
RUODU WANG, University of Waterloo
Distributions complètement mélangeables

Une distribution complètement mélangeable, définie comme la distribution marginale de variables aléatoires dépendantes et identiquement distribuées ayant une somme constante, a été proposée en 2011. Dans cet exposé, je présente la théorie et les applications de la famille des distributions complètement mélangeables. Cette famille de distributions est pertinente en actuariat et en gestion quantitative du risque; elle joue un rôle important dans la résolution de problèmes d'agrégation des risques avec une structure de dépendance inconnue.