

---

**C. J. ADCOCK**, Sheffield University

*Distribution normale - gamma étendue multivariée*

Cet article décrit une version étendue de la distribution normale - gamma étendue multivariée et ses propriétés. La distribution est fermée sous conditionnement et les valeurs d'asymétrie et d'aplatissement standardisées peuvent devenir arbitrairement grandes. Ces propriétés permettent au modèle une application à l'économie financière, notamment aux catégories d'actifs dont le rendement est sévèrement asymétrique. Tous les moments de la distribution existent, propriété importante pour la sélection générale de portefeuille. La distribution asymétrique - normale étendue multivariée est un cas spécial.