
CLAUDIA CZADO, Technische Universität München

Vignes: Construction de copules multivariées au moyen de copules construites par paires

Les classes de copules multivariées classiques, comme les copules elliptiques et archimédiennes, présentent un comportement caudal et symétrique limité en raison de leur fermeture sous les marges. Il n'est pas nécessairement possible de répondre à ces limites dans le cadre d'applications à des données réelles. En revanche, les modèles de copules en vignes sont très flexibles. Ils sont construits en utilisant uniquement des composantes bivariées appelées copules par paires. La spécification complète d'un modèle en vignes nécessite le choix de la structure de l'arbre en vignes, de la famille de copule pour chaque paire et de leurs paramètres respectifs. Je présente cette classe de copules et discute leur inférence statistique, y compris le choix du modèle. La méthode proposée est illustrée à l'aide de données financières.