
HAIJUN LI, Washington State University

Densités des queues de copules

Si elle existe, la densité de la queue d'une copule est une densité limite de copule mise à l'échelle de façon appropriée qui permet d'étudier les valeurs extrêmes multivariées. Dans cet exposé, nous étudions les mélanges de copules à l'aide des densités de queues et nous montrons comment transformer la dépendance caudale des copules de l'indépendance vers la dépendance (et vice-versa) par le biais de mélanges aléatoires. Nous abordons aussi une application relative à la déformation de la queue.