
ARTHUR CHARPENTIER, Université du Québec à Montréal

Estimation de quantiles à partir de distributions à ailes relevées

Dans cet article, nous estimons les quantiles (et d'autres mesures du risque) à partir d'une estimation de la densité non paramétrique fondée sur des données transformées. Nous utilisons initialement une fonction de répartition paramétrique pour transformer les données en valeurs sur l'intervalle unitaire, desquelles nous obtenons une estimation de la densité non paramétrique. Enfin, nous obtenons une estimation de la densité de l'échantillon original par transformation inverse. Cette approche est particulièrement utile pour estimer des distributions à ailes relevées. Nous discutons son implémentation et examinons les propriétés pour des échantillons de taille finie pour l'estimation de la densité, ainsi que l'estimation et l'inférence de quantiles.