
FRANCOIS PERRON, University of Montreal
Sur les possibles prolongements d'une sous-copule

Le théorème de Sklar dit que toute sous-copule admet un prolongement en une copule. Des prolongements simples sont connus. On cherche à obtenir une façon de décrire tous les prolongements possibles. Notre problème est résolu dans le cas où la sous-copule est associée à des variables aléatoires discrètes. Pour des sous-copules quelconques des solutions décrivant tous les prolongements possibles existent mais les méthodologies proposées reposent sur des résultats erronnés. Dans cet exposé nous allons présenter notre solution. Nous allons aussi aborder le problème de trouver, parmi tous les prolongements possibles, celui qui atteint le maximum. Encore une fois, pour les sous-copules associées à des variables discrètes la solution est compliquée. Notre solution est autrement plus simple.