



UE VEX : Valeurs EXtrêmes et applications

Master sciences et technologies
Mention Mathématiques-Informatique
Spécialité MatIS

Semestre : 2ème année, 1er semestre
Parcours : optionnelle en MIS et IMOI
Volume horaire : 16h – **Crédits** : 3 ECTS
Intervenants : Alexandre Berred

Objectifs

Fournir des éléments de base pour poursuivre des recherches dans le domaines des valeurs extrêmes.

Pré-requis (le cas échéant) : Processus stochastiques de M1 Math

Contenu de l'UE

Phénomènes extrêmes
Domaines d'attractions
Statistiques des extrêmes

Bibliographie

- P. Embrechts, C. Klüppelberg, T. Mikosch. Modelling Extremal Events for Insurance and Finance, Springer-Verlag Berlin, 2002.
- Bärbel Finkenstädt, H. Rootzén, Extreme Values in Finance, Telecommunications and the Environment., Chapman & Hall, 2004.
- E. Castillo, Extreme Value Theory in Engineering. Academic Press New York, 1988.