

1 Tutoriel :

- Rappels sur les principaux résultats de théorie des valeurs extrêmes ;
- Estimation de quantiles extrêmes.

2 Estimation d'un quantile extrême sur données de dépassement de seuil

La problématique est issue d'un cas industriel : l'étude de la résistance d'un matériau pour des probabilités de rupture cibles très faibles. La présentation portera sur l'étude d'une procédure séquentielle d'estimation du quantile extrême d'une variable dont les observations sont complètement censurées.