

FONCTION DE QUEUE (C5)

(06 / 12 / 2019, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2019)

Soit (Ω, \mathcal{F}, P) un **espace probabilisé** et $\xi : \Omega \mapsto \mathbf{R}$ une **vars** dont la **fonction de répartition** est notée F .

(i) On appelle **fonction de queue**, ou **fonction d'extrémité**, de F (ou de ξ) la fonction $\varepsilon : [1, +\infty[\mapsto \mathbf{R}$ définie par :

$$(1) \quad \varepsilon(y) = \lim_{x \rightarrow +\infty} \{1 - F(x \cdot y)\} / \{1 - F(x)\}, \quad \forall y \in [1, +\infty[.$$

(ii) On peut souvent approximer ε par des fonctions tq $\varepsilon_1(y) = y^{-\alpha}$ (avec $\alpha > 0$) ou $\varepsilon_2(y) = \varepsilon - y^\beta$ (avec $\beta > 0$), etc (cf **domaine d'attraction**, **queue d'une loi**, **valeur extrême**).

(iii) On peut aussi définir une fonction de queue pour un **vecteur aléatoire** réel.