

## **Mesures et décomposition du risque en présence de dépendance**

**Mélina Mailhot, Concordia University**

Les mesures de risques sont utilisées afin de fournir de l'information par rapport à un niveau jugé critique d'un (ou plusieurs) risque(s). Elles sont utilisées notamment en santé, économie, environnement, finance et assurance. Dans cette présentation, les résultats du développement et de l'étude de mesures de risques basées sur les fonctions de répartitions de variables aléatoires, possiblement dépendantes, seront illustrés. Plus particulièrement, l'intérêt sera porté sur la mesure Range Value-at-Risk, qui représente une moyenne, bornée, de valeurs au-delà du seuil critique, en présence de distributions de valeurs extrêmes. Des techniques et propriétés afin de décomposer le risque attribuable à chaque variable aléatoire d'un ensemble multivarié, agrégé ou non, seront aussi décrites.