

POT: modelling peaks over a threshold

The Generalised Pareto Distribution (GPD) is the limiting distribution of normalised excesses over a threshold, as the threshold approaches the endpoint of the variable (Pickands, 1975). The POT package contains useful tools to perform statistical analysis for peaks over a threshold using the GPD approximation. There is many packages devoted to the extreme value theory (evd, ismev, evir,...); however, the POT package is specialised in peaks over threshold analysis. Moreover, this is currently the only one which proposes many estimators for the GPD. A user's guide (as a package vignette) and two demos are also included in the package.

Auteurs du document : Ribatet, M.

Mots clés : MODELISATION, ANALYSE STATISTIQUE, PROGRAMMATION INFORMATIQUE, THEORIE DES VALEURS EXTREMES, GPD, INFERENCE, CODE DEVELOPMENT, MODELLING, STATISTICAL METHODS, COMPUTER PROGRAMMING

Date : 2007

Format : text/xml

Source : 17442

Langue : Inconnu

Droits d'utilisation : Date de dépôt: 2007-01-03 - Tous les documents et informations contenus dans la base CemOA Publications sont protégés en vertu du droit de propriété intellectuelle, en particulier par le droit d'auteur. La personne consultant la base CemOA Publications peut visualiser, reproduire, ou stocker des copies des publications, à condition que l'information soit seulement pour son usage personnel et non commercial. L'utilisation des travaux universitaires est soumise à autorisation préalable de leurs auteurs. Toute information relative au signalement d'une publication contenue dans CemOA Publications doit inclure la citation bibliographique usuelle : Nom du ou des auteurs, titre et source du document, date et URL de la notice (dc_identifiant).

Télécharger les documents : <https://irsteadox.irstea.fr/cemOA/PUB00020770>

Permalien : <https://www.documentation.eauetbiodiversite.fr/notice/pot-modelling-peaks-over-a-threshold0>

Evaluer cette notice: