2. Intro

Objectif, échantillonnage

5. Variable modélisée

46 ans données journalières, mais n’importe qu’elle autre variable

6. Approche POT

Extremes définis comme des dépassements d’un seuil

7. Seuil par regression quantile

Saisonnalitée marquee, seuil

8. NHPP

Modèle avec 3 paramètres,

NS avec hyperparamètres

Ces hyperparamètres qu’on va échantillonner et ajouter ou retirer pour échantillonner le différents modèles

10. Echantillonnage avec algorithm MCMC, random walk qui va converger vers la distribution qu’on cherche.

11. Echantillonnage des hyperparamètres avec algorithm M-H

Accepter ou rejetée les valeurs proposes

12. Echantillonage des modèles par reversible jump

Changer ou non de modèle (ajouter ou retirer des hyperparamètres)