
LOUIS-PAUL RIVEST, Université Laval

Quelques applications des modèles de copule échangeables

On utilise des copules multidimensionnelles échangeables pour modéliser la corrélation intra-grappe. De nouveaux estimateurs, basés sur les copules, pour le coefficient de corrélation intra-grappe de données discrètes et continues sont construits. L'utilisation des copules constitue une alternative à l'inclusion d'un effet grappe aléatoire pour représenter une dépendance intra-grappe. Quelques propriétés de prédictions de la moyenne d'une grappe construites à l'aide de copules sont données. Ceci permet de construire des nouveaux prédicteurs, basés sur les copules, pour des caractéristiques de petits domaines.