
PORDELI POONEH, University of Calgary

Estimation dans la régression des risques additive à index unique partiellement linéaire avec des données d'état actuel

Nous proposons un modèle de régression des risques additif à index unique partiellement linéaire pour des données d'état actuel. Les covariables linéaires sont dépendantes du temps, contrairement aux covariables non linéaires. Le modèle proposé peut modéliser les effets sur le risque des covariables linéaires et non linéaires et évite la « malédiction de la dimensionnalité ». Nous utilisons des B-splines pour modéliser les fonctions à covariables non paramétriques et dérivons les propriétés asymptotiques des estimateurs par la théorie des processus de comptage. Nous présentons des études de simulation pour comparer la nouvelle méthode avec le modèle de régression des risques additif linéaire standard.