
XUEWEN LU, University of Calgary

Sélection de variables pour modèles à un index partiellement linéaires et censurés

Nous considérons la sélection de variables pour des modèles à un index partiellement linéaires avec des échantillons aléatoirement censurés. Nous adoptons une procédure pondérée et profilée des moindres carrés pour l'estimation des coefficients de régression. Nous invoquons l'approche de la pénalité lisse coupée de la déviation absolue (SCAD) pour la sélection de modèles et l'estimation simultanée. Nous montrons que les estimateurs SCAD qui en résultent sont convergents et possèdent la propriété "oracle". Nous modifions le paramètre de réglage du sélecteur BIC pour le cas des données complètes et montrons que le BIC modifié peut identifier le vrai modèle de façon consistante. Nous présentons des résultats de simulation pour illustrer le propos.