

---

**LOTFI KHRIBI**, HEC Montréal

*Application du principe d'entropie maximale dans la prédiction des évènements récurrents dans le cas des processus de Poisson*

Nous suggérons un modèle bayésien afin de prévoir le nombre futur d'évènements pour des sujets déjà sous observation où la distribution a priori est obtenue par le principe d'entropie maximale. La fonction d'intensité que nous emploierons pour modéliser ces évènements correspond à un processus de Poisson homogène où les taux sont des paramètres. La loi a priori est obtenue en maximisant l'entropie sujette à la condition que les deux premiers moments théoriques égalent leurs équivalents empiriques. Nous avons trouvé, à l'aide d'une étude de simulation, que la loi a priori d'entropie maximale est préférable à la loi a priori de Jeffreys.