
HAOCHENG LI, University of Waterloo

Une méthode de sélection de variables pour les modèles à effets aléatoires

Les modèles à effets aléatoires sont fréquemment utilisés pour l'analyse de données longitudinales. L'inclusion de covariables inutiles et des effets aléatoires dans le modèle peut diminuer la qualité des résultats de façon considérable. Pour résoudre ce problème, nous explorons une méthode de sélection de variables qui permet de sélectionner simultanément des effets fixes et aléatoires. Notre méthode est basée sur une pénalisation de la fonction de vraisemblance composite. Des études empiriques seront présentées pour analyser la performance de la méthode proposée.