
WAN-CHEN LEE, University of Manitoba

À propos de l'imbrication de lois exponentielles courbes et de ses applications

Dans un modèle de régression, la moyenne et la variance de la variable de réponse peut être une fonction du paramètre, comme $E(Y | X) = X\theta$ et $Var(Y | X) = \gamma(\theta)$. Dans un tel cas, l'estimateur aux moindres carrés est souvent incohérent. L'estimateur de quasi vraisemblance est peu efficace, toutefois, il peut être convergent. Nous proposons un estimateur fondé sur une procédure d'imbrication de lois exponentielles courbes. L'estimateur dérivé de cette procédure présente bon nombre de propriétés optimales et notamment, la convergence et le taux exponentiel de convergence. Un exemple illustre la procédure et les résultats.