
JIANDONG REN, Western University

Estimation des paramètres des distributions de type phase multivariées en temps discret

Cet article étudie l'estimation des paramètres d'une classe de distributions de type phase multivariées en temps discret (ou DMPH). Ces distributions de type phase en temps discret sont basées sur les chaînes de Markov en temps discret avec transitions marquées, introduites par He et Neuts (1998), et sont une généralisation des distributions de type phase univariées en temps discret. Nous présentons les propriétés des DMPH et développons un algorithme EM permettant d'estimer les paramètres des DMPH. Nous donnons ensuite des exemples numériques pour répondre à des problèmes de sélection de paramètres intéressants et montrer les applications potentielles des DMPH.