
MARYAM SOHRABI, University of Ottawa

Bootstrap pour les estimations robustes du vecteur moyen pour des distributions de probabilité à ailes lourdes aléatoires avec différents indices de stabilité

Nous considérons une estimation robuste du vecteur moyen pour une séquence d'observations avec distribution indépendante et identique dans le domaine d'attraction d'une loi stable avec différents indices de stabilité $(\alpha_1, \dots, \alpha_p)$ tels que $1 < \alpha_i \leq 2$, $i = 1, \dots, p$. L'estimateur suggéré est asymptotiquement normal selon des paramètres inconnus. Nous appliquons une méthode bootstrap asymptotiquement valide afin de bâtir les intervalles de confiance et les régions de confiance pour le vecteur moyen.

Mots clés: Processus stable; M-estimateur; intervalle de confiance; bootstrap