

---

**WEI TU**, University of Alberta

*M-Estimation généralisée robuste et efficace dans des modèles de régression*

On a présenté une nouvelle classe d'estimateurs robustes pour le modèle de régression linéaire et le modèle de régression logistique. Ce sont des M-estimateurs généralisés par l'absorption d'une mesure de la qualité de l'ajustement dans une fonction de pondération continue. La mesure de la qualité de l'ajustement a été calculée au moyen de la distribution empirique des résidus d'un premier estimateur robuste dans des modèles de régression linéaire, et au moyen des distances de Mahalanobis dans des modèles de régression logistique. Une étude de Monte-Carlo a montré que les estimateurs proposés étaient presque totalement efficaces lorsqu'on maintenait les bonnes propriétés de robustesse. La convergence asymptotique a été prouvée en utilisant des méthodes de processus empiriques.