
TAKUMA KUROSAWA, Tokyo University of Science

Normalité asymptotique des estimateurs du maximum de vraisemblance partielle pour des séries chronologiques binaires sur des modèles de transition

Dans cette étude, nous considérons un modèle de transition pour traiter des séries chronologiques binaires dont les observations binaires dépendent d'observations passées et des covariables. Pour estimer les paramètres du modèle, nous pouvons utiliser la méthode d'estimation du maximum de vraisemblance partielle. Nous montrons que les estimateurs sont asymptotiquement normaux sous certaines conditions. En outre, nous étudions ce comportement asymptotique des estimateurs avec taille finie de l'échantillon à l'aide d'études de simulation.