

Estimation LASSO dans le modèle linéaire censuré
AMÉLIE DETAIS, JEAN-FRANÇOIS DUPUY, JEAN-CLAUDE FORT
Laboratoire de Statistique et Probabilités
Université Paul Sabatier, 118 route de Narbonne
31062 Toulouse cedex 9
detais@cict.fr

Soit (X_i, Y_i) un n -échantillon de vecteurs où X_i est un p -vecteur de variables explicatives observables et Y_i est la variable réponse réelle. Nous supposons que Y_i peut être aléatoirement censurée à droite. Nous nous plaçons dans le cadre du modèle de régression linéaire classique $Y = X\beta + \varepsilon$, où ε est une erreur. Nous introduisons un nouvel estimateur du paramètre inconnu β en utilisant le critère des moindres carrés pénalisé LASSO et en pondérant par l'estimateur de Kaplan-Meier. Des résultats de consistance et de normalité asymptotique sont obtenus pour cet estimateur.