
Estimateurs des log-moments et combinés de lois stables symétriques

Caroline Robet*¹

¹Laboratoire de Mathématiques Jean Leray – Université de Nantes, Centre National de la Recherche Scientifique : UMR6629 – France

Résumé

L'étude des log-moments des lois stables symétriques permet de construire un estimateur explicite, simple à implémenter et pour lequel on a un théorème central limite. Pour les petits échantillons, nous proposons un nouvel estimateur construit à partir de la combinaison d'estimateurs déjà existants. Cet estimateur combiné a de meilleures performances que chaque estimateur pris séparément. On terminera par des applications, en particulier à l'estimation de la fonction d'intensité du mouvement de Lévy multistable.

*Intervenant