

Master Mathématiques appliquées, statistique

Mathematical statistics

Informations

Composante : Faculté des Sciences

Langue(s) d'enseignement

Anglais

Contenu

Dans ce cours, nous étudions quelques théorèmes limites particulièrement utiles en statistique mathématique. Quelques illustrations des notions théoriques abordées en cours pourront être fournies à l'aide du logiciel R.

Résumé :

- 1) Expérience statistique - Modèles statistiques paramétriques.
- 2) Estimation du maximum de vraisemblance :
 - Cohérence,
 - normalité asymptotique.
- 3) Bootstrap :
 - cohérence,
 - exactitude d'ordre supérieur.
- 4) Introduction à la théorie du minimax.

Compétences à acquérir

- Construire des estimateurs pour une expérience statistique donnée.
- Calculer certaines de leurs propriétés
- Construire des intervalles de confiance bootstrap appropriés.

Bibliographie, lectures recommandées

Serfling, R. Approximation theorems of mathematical statistics. Wiley series in probability and statistics.

Bertail, A.E. Dudek - Bootstrap for Dependent Data (with R package) in preparation.

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures

Codes Apogée

- SMSBU29C [ELP]
- SMSBU29C [LIST]

Pour plus d'informations

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 07/10/2024