

Master Mathématiques appliquées, statistique

Computational statistics

Informations

Composante : Faculté des Sciences

Langue(s) d'enseignement

Anglais

Contenu

- Simulation de variables aléatoires, de vecteurs gaussiens
- Méthode de Monte-Carlo
- Échantillonnage préférentiel
- Bootstrap
- Algorithme de Gibbs pour la statistique bayésienne

Compétences à acquérir

- Simuler des données suivant un modèle statistique
- Utiliser une méthode de Monte-Carlo pour évaluer le risque d'un estimateur ou la puissance d'un test
- Utiliser une méthode de Monte-Carlo pour approcher une espérance, une intégrale multiple, une fonctionnelle d'une loi donnée
- Évaluer l'erreur d'inférence avec un intervalle bootstrap
- Programmer un algorithme de Gibbs bivarié ciblant une loi a posteriori

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 12 heures
- Travaux pratiques: 12 heures

Codes Apogée

- SMSBU30C [ELP]

Pour plus d'informations

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



Dernière modification le 07/10/2024