

Probabilités 3 : estimations

Niveau : L2

Cursus :

Semestre : S4

Volume horaire : 18CM 18TD

Intervenant : Mathieu Sart + ?

Contact :

Objectifs du cours :

Ce cours introduit les concepts d'échantillonnage, d'intervalles de confiance, et d'estimateurs statistique. Il présente et étudie deux grandes méthodes de construction d'estimateurs : la méthode des moments et la méthode du maximum de vraisemblance. Leurs propriétés sont étudiées dans de nombreux exemples.

Plan de cours :

1. Rappels sur les théorèmes de convergence de variables aléatoires
2. Notion d'échantillonnage
3. Intervalles de confiance
4. Définition d'un estimateur et propriétés
5. Méthode des moments
6. Méthode du maximum de vraisemblance

Modalités d'évaluation :

Evaluation en contrôle continu intégral.
Deux évaluations sont prévues.

Prérequis (à mentionner uniquement s'il y en a) :

Méthodes quantitatives 1 : mathématiques pour l'économie
Méthodes quantitatives 2 : algèbre linéaire
Probabilité et Intégration
Probabilités 2 : notions d'aléatoire en dimension multiple