



I N S E A





2

5

Modelle Fréquentiste:

Soit un échantillon de n variables aléatoires indépendantes X_1, \dots, X_n modélisées par une loi paramétrée par θ .

1. Considère que θ est une **constante** à estimer.
2. Maximise la vraisemblance $\mathbb{P}(X_1, \dots, X_n; \theta) = \prod_{i=1}^n \mathbb{P}(X_i; \theta)$ par rapport à θ .
3. Obtient un estimateur $\hat{\theta}$ qui dépend des variables X_1, \dots, X_n .

Soit un phénomène dont on observe des variables aléatoires i.i.d X_1, \dots, X_n modélisées par une loi paramétrée par θ .

Modèle Fréquentiste:

1. Considère que θ est une **constante** à estimer.
2. Maximise la vraisemblance $\mathbb{P}(X_1, \dots, X_n; \theta) = \prod_{i=1}^n \mathbb{P}(X_i; \theta)$ par rapport à θ .
3. Obtient un estimateur $\hat{\theta}$ qui dépend des variables X_1, \dots, X_n .



1. Introduction

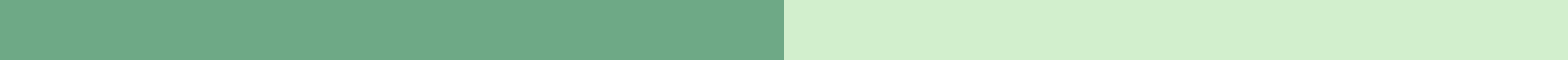
2. Les Bayésiens vs Les fréquentistes

3. Rappels de probabilités (exemples)

4. Loi a posteriori et modèles conjugués

5. Estimateur de Bayes





Soit un phénomène dont on observe des variables aléatoires i.i.d X_1, \dots, X_n modélisées par une loi paramétrée par θ .

