

MAP 433 : Introduction aux méthodes statistiques. Cours 4

18 Septembre 2015

Aujourd'hui

- 1 Rappels
 - Principe de maximum de vraisemblance
- 2 Loi asymptotique des Z - et M - estimateurs
 - Approche asymptotique
- 3 Modèles réguliers et information de Fisher
 - Construction de l'information de Fisher
 - Modèle régulier
 - Cadre général et interprétation géométrique

M-estimation

- Situation : on observe X_1, \dots, X_n de loi \mathbb{P}_θ sur \mathbb{R} et $\theta \in \Theta$.
- Principe : Se donner une application $\psi : \Theta \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}_+$ telle que, pour tout $\theta \in \Theta \subset \mathbb{R}^d$,

$$\alpha \rightsquigarrow \mathbb{E}_\theta [\psi(\alpha, X)] = \int \psi(\alpha, x) \mathbb{P}_\theta(dx)$$

admet un maximum ou un minimum en $\alpha = \theta$.

Definition

On appelle *M-estimateur* associé à ψ tout estimateur $\hat{\theta}_n$ satisfaisant

$$\sum_{i=1}^n \psi(\hat{\theta}_n, X_i) = \max_{\alpha \in \Theta} \sum_{i=1}^n \psi(\alpha, X_i).$$

Au lieu de maximiser, on peut aussi minimiser

Paramètre de localisation

- $\Theta = \mathbb{R}$, $\mathbb{P}_\theta(dx) = f(x - \theta)dx$, et $\int_{\mathbb{R}} xf(x)dx = 0$,
 $\int_{\mathbb{R}} x^2 \mathbb{P}_\theta(dx) < +\infty$ pour tout $\theta \in \mathbb{R}$. On pose

$$\psi(\alpha, x) = (\alpha - x)^2$$

- La fonction

$$\alpha \rightsquigarrow \mathbb{E}_\theta [\psi(\alpha, X)] = \int_{\mathbb{R}} (\alpha - x)^2 f(x - \theta)dx$$

admet un **maximum** en $\theta = \mathbb{E}_\theta [X] = \int_{\mathbb{R}} xf(x - \theta)dx = \theta$.

- **M-estimateur associé :**

$$\hat{\theta}_n = \operatorname{argmin}_{\alpha \in \mathbb{R}} \sum_{i=1}^n (X_i - \alpha)^2 = n^{-1} \sum_{i=1}^n X_i.$$

Paramètre de localisation

- C'est **aussi** un Z -estimateur associé à $\phi(\alpha, x) = 2(x - \alpha)$: on résout

$$\sum_{i=1}^n (X_i - \alpha) = 0 \quad \text{d'où} \quad \hat{\theta}_n = \bar{X}_n.$$

- Dans cet **exemple très simple**, tous les points de vue coïncident.
- Si, dans le même contexte, $\int_{\mathbb{R}} x^2 \mathbb{P}_{\theta}(dx) = +\infty$ et $f(x) = f(-x)$, on peut utiliser Z -estimateur avec $\phi(\alpha, x) = \text{Arctg}(x - \alpha)$. Méthode robuste, mais est-elle optimale ? Peut-on faire mieux **si f est connue ? A suivre...**

Lien entre Z - et M - estimateurs

- **Pas d'inclusion** entre ces deux classes d'estimateurs **en général** :
 - Si ψ non-régulière, M -estimateur \nRightarrow Z -estimateur
 - Si une équation d'estimation admet plusieurs solutions distinctes, Z -estimateur \nRightarrow M -estimateur (cas d'un extremum local).
- Toutefois, si ψ **est régulière**, les M -estimateurs **sont** des Z -estimateurs : si $\Theta \subset \mathbb{R}$ ($d = 1$), en posant

$$\phi(\alpha, x) = \partial_{\theta}\psi(\alpha, x),$$

on a

$$\sum_{i=1}^n \partial_{\theta}\psi(\alpha, X_i) \Big|_{\alpha=\hat{\theta}_n} = \sum_{i=1}^n \phi(\hat{\theta}_n, X_i) = 0.$$

Fonction de vraisemblance

- La famille $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$ est dominée par une mesure σ -finie μ .
On se donne, pour $\theta \in \Theta$

$$f(\theta, x) = \frac{d\mathbb{P}_\theta}{d\mu}(x), \quad x \in \mathbb{R}.$$

Fonction de vraisemblance du n -échantillon associée à la famille $\{f(\theta, \cdot), \theta \in \Theta\}$:

$$\theta \rightsquigarrow \mathcal{L}_n(\theta, X_1, \dots, X_n) = \prod_{i=1}^n f(\theta, X_i)$$

Remarques

■ Log-vraisemblance :

$$\begin{aligned}\theta \rightsquigarrow \ell_n(\theta, X_1, \dots, X_n) &= n^{-1} \log \mathcal{L}_n(\theta, X_1, \dots, X_n) \\ &= n^{-1} \sum_{i=1}^n \log f(\theta, X_i).\end{aligned}$$

Bien défini si $f(\theta, \cdot) > 0$ μ -pp.

Max. vraisemblance = max. log-vraisemblance.

- L'estimateur du maximum de vraisemblance **ne dépend pas** du choix de la mesure dominante μ .
- **Racine de l'équation de vraisemblance** : tout estimateur $\hat{\theta}_n^{\text{rv}}$ vérifiant

$$\nabla_{\theta} \ell_n(\hat{\theta}_n^{\text{rv}}, X_1, \dots, X_n) = 0.$$

l'EMV est un M-estimateur

- On pose

$$\psi(\alpha, x) := \log f(\alpha, x), \quad \alpha \in \Theta, \quad x \in \mathbb{R}$$

(on suppose que $f(\alpha, \cdot) > 0$.)

- La fonction

$$a \rightsquigarrow \mathbb{E}_{\theta} [\psi(\alpha, X)] = \int_{\mathbb{R}} \log f(\alpha, x) f(\theta, x) \mu(dx)$$

a un maximum en $\alpha = \theta$ d'après l'inégalité de convexité.

└ Rappels

└ Principe de maximum de vraisemblance

- Le M -estimateur associé à ψ maximise la fonction

$$\alpha \rightsquigarrow \sum_{i=1}^n \log f(\alpha, X_i) = \ell_n(\alpha, X_1, \dots, X_n)$$

c'est-à-dire la **log-vraisemblance**. C'est l'**estimateur du maximum de vraisemblance**.

- C'est aussi un Z -estimateur si la fonction $\theta \rightsquigarrow \log f(\theta, \cdot)$ est régulière, associé à la fonction

$$\phi(\theta, x) = \partial_{\theta} \log f(\theta, x) = \frac{\partial_{\theta} f(\theta, x)}{f(\theta, x)}, \quad \theta \in \Theta, x \in \mathbb{R}$$

lorsque $\Theta \subset \mathbb{R}$, à condition que le maximum de log-vraisemblance n'est pas atteint sur la frontière de Θ . (Se généralise en dimension d .)

Asymptotique des Z - et M -estimateurs

- Problème général **délicat**. Dans ce cours : conditions suffisantes.
- **Convergence** : critère simple pour les M -estimateurs.
- **Vitesse de convergence** : technique simple pour les Z -estimateurs, à condition de savoir que l'estimateur est convergent.
- Sous des hypothèses de régularité, un M -estimateur est un Z -estimateur.

Convergence des M -estimateurs

- Situation : on observe X_1, \dots, X_n i.i.d. de loi dans la famille $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$.
- $\psi : \Theta \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ fonction de contraste.
- Loi des grands nombres :

$$M_n(\alpha) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \psi(\alpha, X_i)$$

converge en \mathbb{P}_θ -probabilité vers

$$M(\alpha, \theta) = \mathbb{E}_\theta [\psi(\alpha, X)]$$

qui atteint son maximum en $\alpha = \theta$

- « à montrer » :

$$\hat{\theta}_n = \arg \max_{\alpha \in \Theta} M_n(\alpha) \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \arg \max_{\alpha \in \Theta} \mathbb{E}_\theta [\psi(\alpha, X)] = \theta.$$

Exemple

- $(X_i)_{i \geq 1}$ variables i.i.d. de loi de densité $(f(x - \theta), \theta \in \mathbb{R})$ où $\int xf(x)dx = 0$ et $\int x^2 f(x)dx = \sigma^2 < \infty$.
- On pose $\psi(\alpha, x) = (\alpha - x)^2$ et donc

$$M_n(\alpha) = n^{-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \alpha)^2 = n^{-1} \sum_{i=1}^n (X_i - \bar{X}_n)^2 + (\bar{X}_n - \alpha)^2$$

$$M(\alpha, \theta) = (\theta - \alpha)^2 + \sigma^2$$

Une illustration

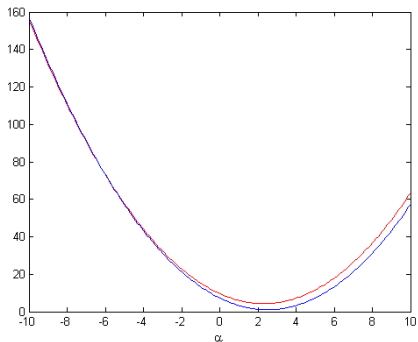


FIGURE – $n = 50$, rouge : $\alpha \mapsto M_n(\alpha)$, bleu : $\alpha \mapsto M(\alpha, \theta)$

Convergence des M -estimateurs

Proposition

Si le M -estimateur $\hat{\theta}_n$ associé à la fonction de contraste est bien défini et si

- $\sup_{\alpha \in \Theta} |M_n(\alpha) - M(\alpha, \theta)| \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} 0$,
- pour tout $\varepsilon > 0$, $\sup_{|\alpha - \theta| \geq \varepsilon} M(\alpha, \theta) < M(\theta, \theta)$ (*condition de maximum*)

alors

$$\hat{\theta}_n \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \theta.$$

- La condition 1 (convergence uniforme) peut être délicate à montrer...

Consistance des M -estimateurs

- Comme $M(\theta, \theta) \geq M(\alpha, \theta)$ et $M_n(\hat{\theta}_n) \geq M_n(\alpha)$,

$$\begin{aligned} 0 \leq M(\theta, \theta) - M(\hat{\theta}_n, \theta) &\leq M(\theta, \theta) - M_n(\theta) + M_n(\hat{\theta}_n) - M(\hat{\theta}_n, \theta) \\ &\leq 2 \sup_{\alpha \in \Theta} |M_n(\alpha) - M(\alpha, \theta)| \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} 0 \end{aligned}$$

Consistance des M -estimateurs

- Comme $M(\theta, \theta) \geq M(\alpha, \theta)$ et $M_n(\hat{\theta}_n) \geq M_n(\alpha)$,

$$\begin{aligned} 0 \leq M(\theta, \theta) - M(\hat{\theta}_n, \theta) &\leq M(\theta, \theta) - M_n(\theta) + M_n(\hat{\theta}_n) - M(\hat{\theta}_n, \theta) \\ &\leq 2 \sup_{\alpha \in \Theta} |M_n(\alpha) - M(\alpha, \theta)| \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} 0 \end{aligned}$$

- Pour tout $\varepsilon > 0$, il existe $\eta > 0$ tel que $M(\alpha, \theta) \leq M(\theta, \theta) - \eta$ pour tout α tel que $|\alpha - \theta| > \varepsilon$.

Consistance des M -estimateurs

- Comme $M(\theta, \theta) \geq M(\alpha, \theta)$ et $M_n(\hat{\theta}_n) \geq M_n(\alpha)$,

$$\begin{aligned} 0 \leq M(\theta, \theta) - M(\hat{\theta}_n, \theta) &\leq M(\theta, \theta) - M_n(\theta) + M_n(\hat{\theta}_n) - M(\hat{\theta}_n, \theta) \\ &\leq 2 \sup_{\alpha \in \Theta} |M_n(\alpha) - M(\alpha, \theta)| \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} 0 \end{aligned}$$

- Pour tout $\varepsilon > 0$, il existe $\eta > 0$ tel que $M(\alpha, \theta) \leq M(\theta, \theta) - \eta$ pour tout α tel que $|\alpha - \theta| > \varepsilon$.
- Par conséquent $\{|\hat{\theta}_n - \theta| \geq \varepsilon\} \subset \{M(\hat{\theta}_n, \theta) \leq M(\theta, \theta) - \eta\}$.

Loi limite des Z -estimateurs

- Situation : on observe X_1, \dots, X_n i.i.d. de loi dans la famille $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$, $\Theta \subset \mathbb{R}$.
- $\hat{\theta}_n$: Z -estimateur associé à $\phi : \Theta \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ vérifie

$$\sum_{i=1}^n \phi(\hat{\theta}_n, X_i) = 0$$

- On suppose la suite $(\hat{\theta}_n)_n$ est **consistante**, i.e. $\hat{\theta}_n \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \theta$. Que dire de sa loi limite ?

Loi limite des Z -estimateurs : principe

■ Loi des grands nombres

$$Z_n(\alpha) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \phi(\alpha, X_i) \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} Z(\alpha, \theta) = \mathbb{E}_\theta [\phi(\alpha, X)]$$

■ Principe. Développement de Taylor autour de θ :

$$0 = Z_n(\hat{\theta}_n) = Z_n(\theta) + (\hat{\theta}_n - \theta)Z'_n(\theta) + \frac{1}{2}(\hat{\theta}_n - \theta)^2 Z''(\tilde{\theta}_n).$$

■ On **néglige** le reste :

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n - \theta) \approx \frac{-\sqrt{n}Z_n(\theta)}{Z'_n(\theta)}$$

Loi limite des Z -estimateurs : principe

- Convergence du **numérateur**

$$\sqrt{n}Z_n(\theta) = \frac{1}{\sqrt{n}} \sum_{i=1}^n \phi(\theta, X_i) \xrightarrow{d} \mathcal{N}(0, \mathbb{E}_{\theta} [\phi(\theta, X)^2])$$

si $\mathbb{E}_{\theta} [\phi(\theta, X)] = 0$ et $\mathbb{E}_{\theta} [\phi(\theta, X)^2] < +\infty$.

- Convergence du **dénominateur**

$$Z'_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \phi(\theta, X_i) \xrightarrow{\mathbb{P}_{\theta}} \mathbb{E}_{\theta} [\partial_{\theta} \phi(\theta, X)]$$

$\neq 0$ (à supposer).

- + hypothèses techniques pour **contrôler le reste** (besoin de la convergence de $\hat{\theta}_n$).

Loi limite des Z -estimateurs

Proposition (Convergence des Z -estimateurs)

- Soit Θ un ouvert de \mathbb{R} . Pour tout $\theta \in \Theta$, $\hat{\theta}_n \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \theta$,
 $\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)^2] < +\infty$ et

$$\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)] = 0, \quad \mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \phi(\theta, X)] \neq 0.$$

- (*Contrôle reste*) pour tout $\theta \in \Theta$, pour tout α dans un voisinage de θ ,

$$|\partial_\theta^2 \phi(\alpha, x)| \leq g(x), \quad \mathbb{E}_\theta [g(X)] < +\infty.$$

Alors

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{\mathbb{E}_\theta[\phi(\theta, X)^2]}{(\mathbb{E}_\theta[\partial_\theta \phi(\theta, X)])^2}\right).$$

Approche asymptotique

- Hypothèse simplificatrice : $\theta \in \Theta \subset \mathbb{R}$. On se restreint aux **estimateurs asymptotiquement normaux** c'est-à-dire vérifiant

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}(0, v(\theta))$$

cf. théorèmes limites obtenus pour les Z -, M -estimateurs.

- Si $\hat{\theta}_{n,1}$ et $\hat{\theta}_{n,2}$ as. normaux de variance asymptotique $v_1(\theta) \leq v_2(\theta)$, alors la précision de $\hat{\theta}_{n,1}$ est **asymptotiquement meilleure** que celle de $\hat{\theta}_{n,2}$ au point θ :

$$\hat{\theta}_{n,1} = \theta + \sqrt{\frac{v_1(\theta)}{n}} \xi^{(n)}$$

$$\hat{\theta}_{n,2} = \theta + \sqrt{\frac{v_2(\theta)}{n}} \zeta^{(n)}$$

où $\xi^{(n)}$ et $\zeta^{(n)} \xrightarrow{d} \mathcal{N}(0, 1)$.

Comparaison d'estimateurs : cas asymptotique

- Si $v_1(\theta) < v_2(\theta)$, et si $\theta \rightsquigarrow v_i(\theta)$ est continue, on pose

$$C_{n,\alpha}(\hat{\theta}_{n,i}) = \left[\hat{\theta}_{n,i} \pm \sqrt{\frac{v_i(\hat{\theta}_{n,i})}{n}} \Phi^{-1}(1 - \alpha/2) \right], \quad i = 1, 2$$

où $\alpha \in (0, 1)$ et $\Phi(\cdot)$ est la fonction de répartition de la loi normale standard.

- $C_{n,\alpha}(\hat{\theta}_{n,i})$, $i = 1, 2$ sont deux **intervalles de confiance asymptotiquement de niveau $1 - \alpha$** et on a

$$\frac{|C_{n,\alpha}(\hat{\theta}_{n,1})|}{|C_{n,\alpha}(\hat{\theta}_{n,2})|} \xrightarrow{\mathbb{P}_{\theta}^n} \sqrt{\frac{v_1(\theta)}{v_2(\theta)}} < 1.$$

- La notion de **longueur minimale possible d'un intervalle de confiance** est en général difficile à manipuler.

Conclusion provisoire

- Il est **difficile en général** de comparer des estimateurs.
- Cadre asymptotique + normalité asymptotique \rightarrow comparaison de la **variance asymptotique** $\theta \rightsquigarrow v(\theta)$.
- Sous des hypothèses de régularité du modèle $\{\mathbb{P}_\theta^n, \theta \in \Theta\}$

alors

- Il **existe** une variance asymptotique $v^*(\theta)$ **minimale** parmi les variances de la classe des M -estimateurs as. normaux.
- Cette fonction est associée à une **quantité d'information intrinsèque** au modèle.
- La variance asymptotique de l'**EMV** est $v^*(\theta)$.
- Ceci règle **partiellement** le problème de l'optimalité.

Régularité d'un modèle statistique et information

- Cadre simplificateur : modèle de densité

$$X_1, \dots, X_n \text{ i.i.d. de loi } \mathbb{P}_\theta$$

dans la famille $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$ avec $\Theta \subset \mathbb{R}$ pour simplifier.

- Notation :

$$f(\theta, x) = \frac{d\mathbb{P}_\theta}{d\mu}(x), \quad x \in \mathbb{R}, \theta \in \Theta.$$

- Hypothèse : la quantité

$$\mathbb{I}(\theta) = \mathbb{E}_\theta \left[(\partial_\theta \log f(\theta, X))^2 \right]$$

est bien définie.

Information de Fisher

Definition

- $\mathbb{I}(\theta) = \mathbb{E}_{\theta} \left[\left(\partial_{\theta} \log f(\theta, X) \right)^2 \right]$ s'appelle *l'information de Fisher* de la famille $\{\mathbb{P}_{\theta}, \theta \in \Theta\}$ au point θ . Elle ne dépend pas de la mesure dominante μ .
- Le cadre d'intérêt est celui où

$$0 < \mathbb{I}(\theta) < +\infty.$$

- $\mathbb{I}(\theta)$ quantifie « l'information » qu'apporte chaque observation X_i sur le paramètre θ .

Remarque : on a $\mathbb{P}_{\theta} [f(\theta, X) > 0] = 1$, donc la quantité $\log f(\theta, X)$ est bien définie.

Le cas multidimensionnel

Si $\Theta \subset \mathbb{R}^d$ avec $d > 1$, tous les résultats s'étendent en remplaçant dérivation par rapport à α par différentiabilité dans \mathbb{R}^d .

L'information de Fisher devient la **matrice d'information de Fisher**.

Definition

La matrice d'information de Fisher $\mathbb{I}(\theta) = (\mathbb{I}(\theta)_{\ell, \ell'})_{1 \leq \ell, \ell' \leq d}$ associée à la famille de densités $\{f(\theta), \theta \in \Theta\}$ avec $\theta \in \Theta \subset \mathbb{R}^d$ est définie au point θ par

$$\mathbb{I}(\theta)_{\ell, \ell'} = \mathbb{E}_{\theta} [\partial_{\theta_{\ell}} \log f(\theta, X) \partial_{\theta_{\ell'}} \log f(\theta, X)], \quad 1 \leq \ell, \ell' \leq d,$$

pour peu que cette quantité soit bien définie, avec

$\theta = (\theta_1, \dots, \theta_d)^T$. C'est une matrice symétrique positive.

Information dans quel sens ? Origine de la notion

- Supposons l'EMV $\hat{\theta}_n^{\text{mv}}$ bien défini et **convergent**.
- Supposons l'application $(\theta, x) \rightsquigarrow f(\theta, x)$ possédant **toutes les propriétés de régularité et d'intégrabilité** voulues.
- Alors

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}\right)$$

en loi sous \mathbb{P}_θ , où encore

$$\hat{\theta}_n^{\text{mv}} \stackrel{d}{\approx} \theta + \frac{1}{\sqrt{n\mathbb{I}(\theta)}} \mathcal{N}(0, 1)$$

en loi sous \mathbb{P}_θ .

Construction de l'information + jeu d'hypothèses attendant

- Heuristique : on établira un jeu d'hypothèses justifiant **a posteriori** le raisonnement.
- Etape 1 : l'EMV $\hat{\theta}_n^{\text{mv}}$ **converge** :

$$\hat{\theta}_n^{\text{mv}} \xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \theta$$

via le théorème de convergence des M -estimateurs.

- Etape 2 : l'EMV $\hat{\theta}_n^{\text{mv}}$ est un **Z-estimateur** :

$$0 = \partial_\theta \left(\sum_{i=1}^n \log f(\alpha, X_i) \right)_{\alpha = \hat{\theta}_n^{\text{mv}}}.$$

Construction de $\mathbb{I}(\theta)$ cont.

- Etape 3 : développement asymptotique **autour de θ** :

$$0 \approx \sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \log f(\theta, X_i) + (\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta) \sum_{i=1}^n \partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X_i),$$

soit

$$\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta \approx - \frac{\sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \log f(\theta, X_i)}{\sum_{i=1}^n \partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X_i)}$$

- Etape 4 : le numérateur. Normalisation et convergence de $\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \log f(\theta, X_i)$?

Numérateur

Lemme

On a

$$\mathbb{E}_{\theta} \left[\partial_{\theta} \log f(\theta, X) \right] = 0.$$

Numérateur

Lemme

On a

$$\mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \log f(\theta, X)] = 0.$$

Démonstration.

$$\begin{aligned}\mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \log f(\theta, X)] &= \int_{\mathbb{R}} \partial_\theta \log f(\theta, x) f(\theta, x) \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}} \frac{\partial_\theta f(\theta, x)}{f(\theta, x)} f(\theta, x) \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}} \partial_\theta f(\theta, x) \mu(dx) = \partial_\theta \int_{\mathbb{R}} f(\theta, x) \mu(dx) = 0.\end{aligned}$$

Dénominateur

De même $\int_{\mathbb{R}} \partial_{\theta}^2 f(\theta, x) \mu(dx) = 0$. **Conséquence :**

$$\mathbb{I}(\theta) = \mathbb{E}_{\theta} \left[\left(\partial_{\theta} \log f(\theta, X) \right)^2 \right] = - \mathbb{E}_{\theta} \left[\partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X) \right]$$

En effet

$$\begin{aligned} \mathbb{E}_{\theta} \left[\partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X) \right] &= \\ &= \int_{\mathbb{R}} \frac{\partial_{\theta}^2 f(\theta, x) f(\theta, x) - (\partial_{\theta} f(\theta, x))^2}{f(\theta, x)^2} f(\theta, x) \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}} \partial_{\theta}^2 f(\theta, x) \mu(dx) - \int_{\mathbb{R}} \frac{(\partial_{\theta} f(\theta, x))^2}{f(\theta, x)} \mu(dx) \\ &= 0 - \int_{\mathbb{R}} \left(\frac{\partial_{\theta} f(\theta, x)}{f(\theta, x)} \right)^2 f(\theta, x) \mu(dx) = - \mathbb{E} \left[\left(\partial_{\theta} \log f(\theta, X) \right)^2 \right]. \end{aligned}$$

Conséquences

- Les $\partial_\theta \log f(\theta, X_i)$ sont i.i.d. et $\mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \log f(\theta, X)] = 0$. TCL :

$$\begin{aligned} \frac{1}{\sqrt{n}} \sum_{i=1}^n \partial_\theta \log f(\theta, X_i) &\xrightarrow{d} \mathcal{N}(0, \mathbb{E}_\theta [(\partial_\theta \log f(\theta, X))^2]) \\ &= \mathcal{N}(0, \mathbb{I}(\theta)). \end{aligned}$$

- Les $\partial_\theta^2 \log f(\theta, X_i)$ sont i.i.d. LGN :

$$\begin{aligned} \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_\theta^2 \log f(\theta, X_i) &\xrightarrow{\mathbb{P}_\theta} \mathbb{E}_\theta [\partial_\theta^2 \log f(\theta, X)] \\ &\stackrel{\text{conséquence}}{=} -\mathbb{I}(\theta). \end{aligned}$$

Conclusion

- En combinant les deux estimations + lemme de Slutsky :

$$\begin{aligned}\sqrt{n}(\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta) &\approx - \frac{\frac{1}{\sqrt{n}} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \log f(\theta, X_i)}{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X_i)} \\ &\xrightarrow{d} \frac{\mathcal{N}(0, \mathbb{I}(\theta))}{\mathbb{I}(\theta)} \\ &\stackrel{\text{loi}}{=} \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}\right).\end{aligned}$$

- Le raisonnement est **rigoureux dès lors que** : (i) on a la convergence de $\hat{\theta}_n^{\text{mv}}$, (ii) on peut justifier le lemme et sa conséquence, (iii) $\mathbb{I}(\theta)$ est bien définie et non dégénérée et (iv) on sait contrôler le terme de reste dans le développement asymptotique, **partie la plus difficile**.

Modèle régulier

Definition

La famille de densités $\{f(\theta, \cdot), \theta \in \Theta\}$, par rapport à la mesure dominante μ , $\Theta \subset \mathbb{R}$, est **régulière** si

- Θ ouvert et $\{f(\theta, \cdot) > 0\} = \{f(\theta', \cdot) > 0\}$, $\forall \theta, \theta' \in \Theta$.
- μ -p.p. $\theta \rightsquigarrow f(\theta, \cdot)$, $\theta \rightsquigarrow \log f(\theta, \cdot)$ sont \mathcal{C}^2 .
- Pour tout $\theta \in \Theta$, il existe $\mathcal{V}_\theta \subset \Theta$ t.q. pour $\alpha \in \mathcal{V}_\theta$

$$|\partial_\theta^2 \log f(\alpha, x)| + |\partial_\theta \log f(\alpha, x)| + (\partial_\theta \log f(\alpha, x))^2 \leq g(x)$$

où

$$\int_{\mathbb{R}} g(x) \sup_{\alpha \in \mathcal{V}(\theta)} f(\alpha, x) \mu(dx) < +\infty.$$

- L'information de Fisher est non-dégénérée : pour tout $\theta \in \Theta$,

Résultat principal

Proposition

- Si l'expérience engendrée par l'observation $X_1, \dots, X_n \sim_{i.i.d.} \mathbb{P}_\theta$ est associée à une famille de probabilités $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$ sur \mathbb{R} **régulière** au sens de la définition précédente, alors

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}\right).$$

- Si $\hat{\theta}_n$ est un Z -estimateur **régulier** asymptotiquement normal de variance $v(\theta)$, alors

$$\forall \theta \in \Theta, \quad v(\theta) \geq \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}.$$

Preuve de la proposition

- Le premier point consiste à **rendre rigoureux** le raisonnement précédent. **Point délicat** : le contrôle du terme de reste.
- **Optimalité de la variance de l'EMV parmi celle des Z -estimateurs** : on a vu que si $\hat{\theta}_n$ est un Z -estimateur régulier associé à la fonction ϕ , alors, sa variance asymptotique $v(\theta) = v_\phi(\theta)$ vaut

$$v_\phi(\theta) = \frac{\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)^2]}{(\mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \phi(\theta, X)])^2}.$$

- **A montrer** : pour toute fonction ϕ :

$$\boxed{\frac{\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)^2]}{(\mathbb{E}_\theta [\partial_\theta \phi(\theta, X)])^2} \geq \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}}.$$

Preuve de l'inégalité

- Comme pour tout $\theta \in \Theta$, $\mathbb{E}_\theta[\phi(\theta, X)] = 0$,

$$\partial_\theta \mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)] = 0.$$

- (avec $\dot{\phi}(\theta, x) = \partial_\theta \phi(\theta, x)$)

$$\begin{aligned} 0 &= \int_{\mathbb{R}} [\dot{\phi}(\theta, x)f(\theta, x) + \phi(\theta, x)\partial_\theta f(\theta, x)]\mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}} [\dot{\phi}(\theta, x)f(\theta, x) + \phi(\theta, x)\partial_\theta \log f(\theta, x)f(\theta, x)]\mu(dx). \end{aligned}$$

- Conclusion

$$\mathbb{E}_\theta [\dot{\phi}(\theta, X)] = - \mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)\partial_\theta \log f(\theta, X)]$$

Preuve de l'inégalité (fin)

- On a

$$\mathbb{E}_\theta [\dot{\phi}(\theta, X)] = -\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X) \partial_\theta \log f(\theta, X)]$$

- Cauchy-Schwarz :

$$(\mathbb{E}_\theta [\dot{\phi}(\theta, X)])^2 \leq \mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)^2] \mathbb{E}_\theta [(\partial_\theta \log f(\theta, X))^2],$$

c'est-à-dire

$$v_\phi(\theta)^{-1} = \frac{(\mathbb{E}_\theta [\dot{\phi}(\theta, X)])^2}{\mathbb{E}_\theta [\phi(\theta, X)^2]} \leq \mathbb{I}(\theta).$$

Le cas multidimensionnel

Proposition

- Si l'expérience engendrée par l'observation $X_1, \dots, X_n \sim_{i.i.d.} \mathbb{P}_\theta$ est associée à une famille de probabilités $\{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$, $\Theta \subset \mathbb{R}^d$ *régulière*, alors

$$\sqrt{n}(\hat{\theta}_n^{\text{mv}} - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}(0, \mathbb{I}^{-1}(\theta)).$$

- Si $\hat{\theta}_n$ est un Z -estimateur *régulier* asymptotiquement normal de *matrice de covariance* $V(\theta)$, alors pour tout $\theta \in \Theta$,

$$V(\theta) \succeq \mathbb{I}^{-1}(\theta).$$

Information de Fisher dans un modèle général

Definition

- *Situation* : suite d'expériences statistiques

$$\mathcal{E}^n = (\mathfrak{Z}^n, \mathcal{Z}^n, \{\mathbb{P}_\theta^n, \theta \in \Theta\})$$

dominées par μ_n , associées à l'observation $Z^{(n)}$,

$$f_n(\theta, z) = \frac{d\mathbb{P}_\theta^n}{d\mu^n}(z), \quad z \in \mathfrak{Z}^n, \theta \in \Theta \subset \mathbb{R}.$$

- *Information de Fisher* (si elle existe) de l'expérience au point θ :

$$\mathbb{I}^n(\theta) = \mathbb{E}_\theta^n \left[\left(\partial_\theta \log f_n(\theta, Z^{(n)}) \right)^2 \right]$$

Interprétation géométrique

- On pose $\mathbb{D}(\alpha, \theta) = \mathbb{E}_\theta [\log f(\alpha, X)]$. On a vu (inégalité d'entropie) que

$$\begin{aligned}\mathbb{D}(\alpha, \theta) &= \int_{\mathbb{R}} \log f(\alpha, x) f(\theta, x) \mu(dx) \\ &\leq \int_{\mathbb{R}} \log f(\theta, x) f(\theta, x) \mu(dx) = \mathbb{D}(\theta, \theta).\end{aligned}$$

- On a

$$\boxed{\mathbb{I}(\theta) = \partial_\alpha^2 \mathbb{D}(\alpha, \theta) \big|_{\alpha=\theta} .}$$

- Si $\mathbb{I}(\theta)$ est « petite », le **rayon de courbure de $\alpha \rightsquigarrow \mathbb{D}(\alpha, \theta)$ est grand** dans un voisinage de θ : la stabilisation d'un maximum empirique (l'EMV) est plus difficile, rendant moins précis l'estimation.
- Si $\mathbb{I}(\theta)$ est « grande », le **rayon de courbure est petit** et le

Efficacité à un pas

- Dans un modèle régulier, le **calcul numérique** de l'EMV peut être difficile à réaliser.
- Si l'on dispose d'un estimateur $\hat{\theta}_n$ **asymptotiquement normal** et si les évaluations

$$\ell'_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta} \log f(\theta, X_i), \quad \ell''_n(\theta) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \partial_{\theta}^2 \log f(\theta, X_i)$$

sont **faciles**, alors on peut **corriger** $\hat{\theta}_n$ de sorte d'avoir le même comportement asymptotique que l'EMV :

$$\tilde{\theta}_n = \hat{\theta}_n - \frac{\ell'_n(\hat{\theta}_n)}{\ell''_n(\hat{\theta}_n)} \quad (\text{algorithme de Newton})$$

satisfait

$$\sqrt{n}(\tilde{\theta}_n - \theta) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\mathbb{I}(\theta)}\right)$$