

# Statistique inférentielle



ECTS



Volume horaire  
39.25h

## Présentation

### Description

- Rappels des définitions et propriétés des lois usuelles (normales, Chi-deux, Student, Fisher, vecteurs gaussiens, etc) et des outils probabilistes (loi des grands nombres, théorème centrale limites, lemme de Slutsky)
- Estimation dans un modèle paramétrique : méthode des moments, maximum de vraisemblance
- Borne de Cramér-Rao et efficacité d'un estimateur
- Estimation par intervalle de confiance pour la moyenne et la variance dans un modèle gaussien et non gaussien
- Tests d'hypothèse en paramétrique : formalisme, test sur la moyenne et sur la variance d'un échantillon gaussien, test sur une proportion, p-valeur, test de comparaison de deux populations gaussiennes indépendantes, test de Neyman-Pearson, test du rapport du maximum de vraisemblance

### Objectifs

A la fin de ce module, l'étudiant devra avoir compris et pourra expliquer (principaux concepts) :

- l'écriture d'un modèle simple par des lois usuelles de probabilité telles que la loi normale, exponentielle, de Bernoulli, de Poisson, etc.
- l'estimation de paramètres dans un modèle

paramétrique

- la construction d'un intervalle de confiance
- la construction d'un test d'hypothèses

L'étudiant devra être capable de :

- Modéliser une situation à l'aide de lois usuelles de probabilité dont les vecteurs gaussiens
- Estimer les paramètres dans un modèle paramétrique et d'étudier les propriétés des estimateurs
- Construire un intervalle de confiance
- Construire un test d'hypothèses, garantir son niveau et calculer sa puissance

### Pré-requis nécessaires

Probabilités et Statistique (2MIC)

### Évaluation

L'évaluation des acquis d'apprentissage est réalisée en continu tout le long du semestre. En fonction des enseignements, elle peut prendre différentes formes : examen écrit, oral, compte-rendu, rapport écrit, évaluation par les pairs...

### Infos pratiques

### Lieu(x)

 Toulouse