

Institut de statistique



STAT2415 Eléments de statistique bayésienne

[15h] 2.5 crédits

Cette activité se déroule pendant le 2ème semestre

Enseignant(s): Philippe Lambert
Langue d'enseignement : français
Niveau : Second cycle

Objectifs (en termes de compétences)

Au terme du cours l'étudiant aura acquis les principes et les techniques de base de la statistique bayésienne, et sera capable de les utiliser et de mettre en évidence leurs avantages et inconvénients dans des problèmes simples.

Objet de l'activité (principaux thèmes à aborder)

- Le modèle bayésien: principes généraux.
- La fonction de vraisemblance et spécification a priori.
- Modèles à un paramètre: choix de la distribution a priori, calcul de la distribution a posteriori, résumer la distribution a posteriori.
- Modèles multiparamètres: choix des distributions a priori et calcul des distributions a posteriori, paramètres de nuisance. Cas des modèles multinomial et gaussien multivarié.
- Inférence en grand échantillon et relation avec l'inférence fréquentiste.
- Méthodes de calcul en analyse bayésienne.

Résumé : Contenu et Méthodes

- Le modèle bayésien: principes généraux.
- La fonction de vraisemblance et spécification a priori.
- Modèles à un paramètre: choix de la distribution a priori, calcul de la distribution a posteriori, résumer la distribution a posteriori.
- Modèles multiparamètres: choix des distributions a priori et calcul des distributions a posteriori, paramètres de nuisance. Cas des modèles multinomial et gaussien multivarié.
- Inférence en grand échantillon et relation avec l'inférence fréquentiste.
- Méthodes de calcul en analyse bayésienne.

Autres informations (Pré-requis, Evaluation, Support, ...)

Ouvrages de référence

Congdon, P. (2001) Bayesian Statistical Modelling. Wiley.
 Gelman, A., Carlin, J.B., Stern, H.S. and Rubin, D.B. (1995) Bayesian Data Analysis. Chapman and Hall.
 Robert, C.P. (1992) L'Analyse Statistique Bayésienne. Paris: Economica.
 Robert, C.P. (1994) The Bayesian Choice. New York: Springer-Verlag.
 Spiegelhalter, D.J., Thomas, A. and Best, N.G. (1999) WinBUGS User Manual. MRC Biostatistics Unit.

Programmes proposant cette activité

STAT2MS Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée
STAT3DA Diplôme d'études approfondies en statistique

Autres crédits de l'activité dans les programmes

STAT21MS	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée
STAT21MS/DM	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée (data management et data mining)
STAT21MS/EA	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée (économie et assurance)
STAT21MS/MM	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée (méthodes mathématiques)
STAT21MS/MS	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée (marketing et sondage)
STAT21MS/ST	Première année du master en statistique, orientation générale, à (2.5 crédits) finalité spécialisée (sciences et technologie)
STAT22MS	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée
STAT22MS/DM	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée (data management et data mining)
STAT22MS/EA	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée (économie et assurance)
STAT22MS/MM	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée (méthodes mathématiques)
STAT22MS/MS	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée (marketing et sondage)
STAT22MS/ST	Deuxième année du master en statistique, orientation générale, (2.5 crédits) à finalité spécialisée (sciences et technologie)
STAT2MS	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits)
STAT2MS/DM	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits) (data management et data mining)
STAT2MS/EA	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits) (économie et assurance)
STAT2MS/MM	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits) (méthodes mathématiques)
STAT2MS/MS	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits) (marketing et sondage)
STAT2MS/ST	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée (2.5 crédits) (sciences et technologie)
STAT3DA	Diplôme d'études approfondies en statistique (2.5 crédits)
STAT3DA/B	diplôme d'études approfondies en statistique (biostatistique et (2.5 crédits) épidémiologie)
STAT3DA/E	diplôme d'études approfondies en statistique (statistique et (2.5 crédits) économétrie)
STAT3DA/M	Diplôme d'études approfondies en statistique (méthodologie de (2.5 crédits) la statistique)
STAT3DA/P	diplôme d'études approfondies en statistique (pratique de la (2.5 crédits) statistique)