

Séminaire de Probabilités et Statistiques

Mardi 26 Janvier à 14h
Salle de conférences

Matthieu Lerasle
(UNS)

Estimateurs sous-gaussiens de la moyenne

Je m'intéresserai dans cet exposé à l'estimation de la moyenne d'une variable aléatoire réelle par des estimateurs présentant des déviations sous-gaussiennes. Je présenterai d'abord une construction de tels estimateurs et montrerai que les déviations sous-gaussiennes restent valides même lorsque la distribution des données n'admet qu'un moment d'ordre 2 connu. Je discuterai ensuite quelques limites dans ce problème et donnerai une méthode d'obtention de borne minimax pour prouver ce type de résultats «négatifs».

Ce travail est issu d'une collaboration avec L. Devroye, G. Lugosi et R. I. Oliveira.